

ОТЧЕТ № 1.1А СТОИМОСТЬ ПОРТФЕЛЯ ПАО "УК "АРСАГЕРА" на 30.06.2017.

Отчет составлен в соответствии с п. 3.6, п.п. 1.1 Положения о Правлении ПАО "УК "Арсатера". В скобках указываются лимиты согласно Инвестиционной декларации для портфеля ПАО "УК "Арсатера".

Стоимость портфеля указывается без учета сделок, по которым не произведена оплата и(или) перерегистрация, а ценные бумаги оцениваются по рыночной цене, объявленной организатором торгов на дату определения стоимости портфеля, в соответствии с порядком, установленным ФСФР России. В случае отсутствия рыночной цены на дату определения стоимости портфеля или если ценная бумага не допущена к обращению, указывается балансовая стоимость.

Наименование актива	Количество ЦБ	Стоимость, руб.	Доля ценных бумаг одного эмитента, % от портфеля	Доля ценных бумаг данного типа, % от портфеля	Доля ценных бумаг (участия) данной категории, % от портфеля
Государственные федеральные облигации					
-					
ГЦБ субъектов и муниципальных облигации, Корпоративные облигации	Тип 5.1 + 2.1			0,00 (100)	0,00 (100)
	Тип 5.2 + 2.2			0,00 (20)	
	Тип 5.3 + 2.3			0,00 (0)	
	Тип 5.4 + 2.4			0,00 (0)	
	Тип 5.5 + 2.5			0,00 (0)	
	Тип 5.6 + 2.6			0,00 (0)	
	Облигации, по которым не исполнено обязательство по погашению основного долга				
Мособлтрастинвест обл., вып.2	5 800				
ФК Еврокоммерц обл., вып.5	4 029				
Акции					
Тип 6.1				97,01 (100)	100,00 (100)
ЛУКОЙЛ	5 588	16 129 762,00	9,06		
Газпром	134 850	16 064 680,50	9,03		
АЛРОСА	117 500	10 236 600,00	5,75		
ФСК ЕЭС	49 170 000	8 420 362,50	4,73		
Российские сети	10 177 000	8 184 343,40	4,60		
Магнитогорский металлургический комбинат	220 900	7 397 941,00	4,16		
АФК Система	587 100	7 124 458,50	4,00		
ФосАгро	3 074	7 048 682,00	3,96		
Аэрофлот	31 800	6 169 200,00	3,47		
Тип 6.2				48,25 (80)	
Башнефть, ап	8 917	10 254 550,00	5,76		
Мечел, ап	47 720	5 945 912,00	3,34		
Энел Россия	4 937 000	5 618 306,00	3,16		
ОГК-2	12 960 000	5 467 824,00	3,07		
Группа ЛСР	6 382	5 226 858,00	2,94		
Акрон	1 503	4 687 857,00	2,63		
Тип 6.3				27,35 (30)	
МОСТОТРЕСТ	53 140	5 712 550,00	3,21		
Нижнекамскнефтехим, ап	221 900	5 525 310,00	3,10		
МРСК Волги	76 540 000	5 250 644,00	2,95		
ЧМК	1 373	5 162 480,00	2,90		
МРСК Центра	11 269 000	4 907 649,50	2,76		
ПРОТЕК	47 900	4 651 090,00	2,61		
МРСК Центра и Приволжья	25 470 000	4 569 318,00	2,57		
Банк Санкт-Петербург	71 570	4 022 234,00	2,26		
Тип 6.4				4,99 (10)	
Открытые инвестиции	5 688	4 385 448,00	2,46		
Возрождение Банк, ап	25 810	3 897 310,00	2,19		
Комбинат Южуралникель	200	600 000,00	0,34		
Тип 6.5				2,99 (3)	
ЦМТ, ап	581 000	3 503 430,00	1,97		
Надеждинский металлургический завод, ап	150	683 572,97	0,38		
Главмосстрой	3 000	615 643,26	0,35		
Центрэнергохолдинг, ап	99 654	513 031,91	0,29		
Банковские депозиты					
Тип 3.1				0,00 (20)	0,00 (20)
Тип 3.2				0,00 (0)	
Тип 3.3				0,00 (0)	
Тип 3.4					
Тип 3.5					
Тип 3.6					
Денежные средства		6 158,62			0,00 (100)
Дебиторская задолженность		222,12			0,00 (30)
Кредиторская задолженность					0,00 (30)
Итого стоимость портфеля ПАО "УК "Арсатера"		177 983 429,28			100,00

Обязательства эмитентов облигаций, не учитываемые при расчете стоимости портфеля*

Ценная бумага (эмитент, серия)	Вид обязательства	Объем неисполненного обязательства, руб.
Мособлтрастинвест обл., вып.2	погашение купона	620 658,00
Мособлтрастинвест обл., вып.2	погашение основного долга	5 800 000,00
ФК Еврокоммерц обл., вып.5	погашение купона	1 449 996,81
ФК Еврокоммерц обл., вып.5	погашение основного долга	4 029 000,00
Итого объем неисполненных эмитентами облигаций обязательств, руб.		11 899 654,81

* действия, предпринятые Управляющей компанией по взысканию задолженности, описаны в отчете № 4.2.

ОТЧЕТ № 1.1Б СТОИМОСТЬ ПОРТФЕЛЯ ПАО "УК "АРСАГЕРА" на 30.06.2017.

Отчет составлен в соответствии с п. 3.6, п.п. 1.1 Положения о Правлении ПАО "УК "Арсатера". В скобках указываются лимиты согласно Инвестиционной декларации для портфеля ПАО "УК "Арсатера".

Стоимость портфеля указывается с учетом сделок, по которым не произведена оплата и(или) перерегистрация, а ценные бумаги оцениваются по цене, определяемой как среднее между последними котировками на покупку и продажу. В случае отсутствия котировок за последние 90 дней ценные бумаги оцениваются по нулевой стоимости.

Наименование актива	Количество ЦБ	Стоимость, руб.	Доля ценных бумаг одного эмитента, % от портфеля	Доля ценных бумаг данного типа, % от портфеля	Доля ценных бумаг (участия) данной категории, % от портфеля
Государственные федеральные облигации					
-					
ГЦБ субъектов и муниципальных облигации,	Тип 5.1 + 2.1			0,00 (0)	0,00 (100)
Корпоративные облигации	Тип 5.2 + 2.2			0,00 (20)	
	Тип 5.3 + 2.3			0,00 (0)	
	Тип 5.4 + 2.4			0,00 (0)	
	Тип 5.5 + 2.5			0,00 (0)	
	Тип 5.6 + 2.6			0,00 (0)	
Облигации, по которым не исполнено обязательство по погашению основного долга					
	Мособлтрастинвест обл., вып.2	5 800			
	ФК Еврокоммерц обл., вып.5	4 029			
Акции	Тип 6.1			97,68 (100)	100,00 (100)
	ЛУКОЙЛ	5 588	16 118 586,00	9,11	
	Газпром	134 850	16 021 528,50	9,06	
	АЛРОСА	117 500	10 177 262,50	5,75	
	ФСК ЕЭС	49 170 000	8 421 591,75	4,76	
	Российские сети	10 177 000	8 161 954,00	4,61	
	АФК Система	611 800	7 480 784,50	4,23	
	Магнитогорский металлургический комбинат	220 900	7 365 910,50	4,16	
	ФосАгро	3 074	7 068 663,00	4,00	
	Аэрофлот	31 800	6 195 435,00	3,50	
	Тип 6.2			48,50 (80)	
	Башнефть, ап	8 917	10 290 218,00	5,82	
	Мечел, ап	47 720	5 827 805,00	3,29	
	Энел Россия	4 937 000	5 647 928,00	3,19	
	ОГК-2	12 960 000	5 502 168,00	3,11	
	Группа ЛСР	6 382	5 201 330,00	2,94	
	Акрон	1 503	4 717 165,50	2,67	
	Тип 6.3			27,48 (30)	
	МОСГОТРЕСТ	53 140	5 685 980,00	3,21	
	Нижнекамскнефтехим, ап	221 900	5 519 762,50	3,12	
	ЧМК	1 373	5 303 212,50	3,00	
	МРСК Волги	76 540 000	5 246 817,00	2,97	
	МРСК Центра	11 269 000	4 879 477,00	2,76	
	ПРОТЕК	47 900	4 651 090,00	2,63	
	МРСК Центра и Приволжья	25 470 000	4 565 497,50	2,58	
	Банк Санкт-Петербург	71 570	4 092 014,75	2,31	
	Тип 6.4			4,90 (10)	
	Открытые инвестиции	5 271	4 103 473,50	2,32	
	Возрождение Банк, ап	25 810	3 981 192,50	2,25	
	Комбинат Южуралникель	200	593 000,00	0,34	
	Тип 6.5			2,31 (3)	
	ЦМТ, ап	581 000	3 747 450,00	2,12	
	Надеждинский металлургический завод, ап	150	243 750,29	0,14	
	Главмосстрой	3 000	99 882,32	0,06	
	Центрэнергохолдинг, ап	99 654	0,00	0,00	
Банковские депозиты	Тип 3.1			0,00 (20)	0,00 (20)
	Тип 3.2			0,00 (0)	
	Тип 3.3			0,00 (0)	
	Тип 3.4			-	
	Тип 3.5			-	
	Тип 3.6			-	
Денежные средства		6 158,62			0,00 (100)
Дебиторская задолженность		299 406,00			0,17 (30)
Кредиторская задолженность		298 624,50			0,17 (30)
Итого стоимость портфеля ПАО "УК "Арсатера"		176 917 870,23			100,00

Обязательства эмитентов облигаций, не учитываемые при расчете стоимости портфеля*

Ценная бумага (эмитент, серия)	Вид обязательства	Объем неисполненного обязательства, руб.
Мособлтрастинвест обл., вып.2	погашение купона	620 658,00
Мособлтрастинвест обл., вып.2	погашение основного долга	5 800 000,00
ФК Еврокоммерц обл., вып.5	погашение купона	1 449 996,81
ФК Еврокоммерц обл., вып.5	погашение основного долга	4 029 000,00
Итого объем неисполненных эмитентами облигаций обязательств, руб.		11 899 654,81

* действия, предпринятые Управляющей компанией по взысканию задолженности, описаны в отчете №9 4.2.