ОТЧЕТ № 1.1А СТОИМОСТЬ ПОРТФЕЛЯ ПАО "УК "АРСАГЕРА" на 30.09.2017.

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

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 муниципальные 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**				**97.34 (100)**	**99.99 (100)**
	ЛУКОЙЛ	5 952	18 222 048.00	9.13		
	Газпром	147 180	17 976 565.20	9.01		
	Сбербанк России	65 640	12 617 977.20	6.32		
	АЛРОСА	125 000	10 231 250.00	5.13		
	ФСК ЕЭС	49 710 000	8 572 489.50	4.30		
	ФосАгро	3 596	8 400 256.00	4.21		
	Аэрофлот	32 900	5 981 220.00	3.00		
	Тип 6.2				**56.25 (80)**	
	Башнефть, ап	9 113	11 523 388.50	5.77		
	Российские сети	9 666 000	9 818 722.80	4.92		
	АФК Система	671 000	8 961 205.00	4.49		
	Группа ЛСР	8 218	6 648 362.00	3.33		
	Энел Россия	5 192 000	6 505 576.00	3.26		
	ОГК-2	11 610 000	6 471 414.00	3.24		
	Мечел, ап	57 940	5 822 970.00	2.92		
	Акрон	1 683	5 742 396.00	2.88		
	Тип 6.3				**25.44 (30)**	
	Нижнекамскнефтехим, ап	229 600	6 132 616.00	3.07		
	МОСТОТРЕСТ	46 980	6 051 024.00	3.03		
	ЧМК	1 506	6 046 590.00	3.03		
	МРСК Центра	11 816 000	5 884 368.00	2.95		
	МРСК Волги	51 420 000	5 823 315.00	2.92		
	МРСК Центра и Приволжья	18 360 000	5 737 500.00	2.87		
	ПРОТЕК	47 900	5 249 840.00	2.63		
	Банк Санкт-Петербург	93 790	5 205 345.00	2.61		
	Тип 6.4				**2.32 (10)**	
	Возрождение Банк, ап	27 150	4 072 500.00	2.04		
	Комбинат Южуралникель	200	566 000.00	0.28		
	Тип 6.5				**2.65 (3)**	
	ЦМТ, ап	581 000	3 480 190.00	1.74		
	Надеждинский металлургический завод, ап	150	683 572.97	0.34		
	Главмосстрой	3 000	615 643.26	0.31		
	Центрэнергохолдинг, ап	99 654	513 031.91	0.26		
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			11 406.66			**0.01 (100)**
Дебиторская задолженность			369.25			**0.00 (30)**
Кредиторская задолженность			200.00			**0.00 (30)**
Итого стоимость портфеля ПАО "УК "Арсагера"			**199 568 952.25**			**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 30.09.2017.

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

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 муниципальные 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**				**98.03 (100)**	**99.99 (100)**
	ЛУКОЙЛ	5 904	18 051 480.00	9.12		
	Газпром	147 180	17 940 506.10	9.06		
	Сбербанк России	65 640	12 647 515.20	6.39		
	АЛРОСА	120 800	9 863 924.00	4.98		
	ФСК ЕЭС	49 710 000	8 516 565.75	4.30		
	ФосАгро	3 596	8 418 236.00	4.25		
	Аэрофлот	32 900	6 048 665.00	3.05		
	Тип 6.2				**56.88 (80)**	
	Башнефть, ап	9 113	11 539 336.25	5.83		
	Российские сети	9 812 000	9 921 403.80	5.01		
	АФК Система	671 000	8 929 332.50	4.51		
	Группа ЛСР	8 218	6 638 089.50	3.35		
	Энел Россия	5 192 000	6 526 344.00	3.30		
	ОГК-2	11 610 000	6 436 003.50	3.25		
	Акрон	1 757	6 006 304.50	3.03		
	Мечел, ап	58 920	5 897 892.00	2.98		
	Тип 6.3				**25.63 (30)**	
	Нижнекамскнефтехим, ап	229 600	6 115 396.00	3.09		
	МОСТОТРЕСТ	46 980	6 029 883.00	3.04		
	ЧМК	1 506	6 024 000.00	3.04		
	МРСК Центра	11 816 000	5 881 414.00	2.97		
	МРСК Волги	51 420 000	5 806 603.50	2.93		
	МРСК Центра и Приволжья	18 360 000	5 743 926.00	2.90		
	ПРОТЕК	47 900	5 276 185.00	2.66		
	Банк Санкт-Петербург	93 790	5 221 758.25	2.64		
	Тип 6.4				**2.35 (10)**	
	Возрождение Банк, ап	27 150	4 086 075.00	2.06		
	Комбинат Южуралникель	200	567 000.00	0.29		
	Тип 6.5					**1.96 (3)**
	ЦМТ, ап	581 000	3 532 480.00	1.78		
	Надеждинский металлургический завод, ап	150	243 750.02	0.12		
	Главмосстрой	3 000	108 636.37	0.05		
	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			11 406.66			**0.01 (100)**
Дебиторская задолженность			495 228.00			**0.25 (30)**
Кредиторская задолженность			499 143.90			**0.25 (30)**
Итого стоимость портфеля ПАО "УК "Арсагера"			**198 026 196.00**			**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.