

РАСЧЕТ СОБСТВЕННЫХ СРЕДСТВ УПРАВЛЯЮЩЕЙ КОМПАНИИ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ, ПАЕВЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ И НЕГОСУДАРСТВЕННЫХ ПЕНСИОННЫХ ФОНДОВ

Расчет собственных средств управляющей компании инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов

Раздел I. Реквизиты управляющей компании

1. Полное наименование управляющей компании: Акционерное общество "Управляющая компания "Стратегия"
2. Номер лицензии управляющей компании: 21-000-1-00550

Раздел II. Параметры расчета собственных средств

Текущая отчетная дата: 31.12.2016

Предыдущая отчетная дата: 30.11.2016

Раздел III. Расчет собственных средств

Таблица: Расчет собственных средств

Наименование показателя	Код строки	Сумма (стоимость, величина) на текущую отчетную дату	Сумма (стоимость, величина) на предыдущую отчетную дату
1	2	3	4
Подраздел «Активы, принятые к расчету собственных средств»			
Денежные средства – всего	01	0,00	0,00
в том числе:			

на счетах в кредитных организациях	01.01	0,00	0,00
на счетах по депозиту в кредитных организациях	01.02	0,00	0,00
Ценные бумаги – всего	02	448 731 370,69	48 763 920,73
в том числе:			
облигации – всего	02.01	47 083 319,66	47 367 367,29
в том числе:			
облигации российских хозяйственных обществ	02.01.01	47 083 319,66	447 367 367,29
государственные ценные бумаги Российской Федерации	02.01.02	0,00	0,00
государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	02.01.03	0,00	0,00
муниципальные ценные бумаги	02.01.04	0,00	0,00
облигации иностранных коммерческих организаций	02.01.05	0,00	0,00
облигации иностранных государств	02.01.06	0,00	0,00
облигации международных финансовых организаций	02.01.07	0,00	0,00
акции – всего	02.02	1 648 051,03	1 396 553,44
в том числе:			
российских акционерных обществ	02.02.01	1 648 051,03	1 396 553,44
иностраных акционерных обществ	02.02.02	0,00	0,00
Недвижимое имущество	03	0,00	0,00
Дебиторская задолженность	04	349 889,62	252 824,00

Общая стоимость активов (сумма строк 01 + 02 + 03 + 04)	05	49 081 260,31	49 016 744,73
Подраздел «Обязательства»			
Общая величина обязательств	06	441 709,95	1 161 240,59
Размер собственных средств			
Размер собственных средств			
(разность строк 05 - 06)	07	48 639 550,36	47 855 504,14
Минимальный размер собственных средств			
Минимальный размер собственных средств	08	10 000 000,00	10 000 000,00
Указание на соответствие размера собственных средств управляющей компании требованиям к минимальному размеру собственных средств (СООТВЕТСТВУЕТ / НЕ СООТВЕТСТВУЕТ)	СООТВЕТСТВУЕТ		

Расшифровки строк подраздела «Активы, принятые к расчету собственных средств»

01.01. Денежные средства на счетах в кредитных организациях

Таблица: 01.01. Денежные средства на счетах в кредитных организациях

Номер строки	Наименование кредитной организации, с которой заключен договор (договоры) банковского счета	ОГРН кредитной организации	Регистрационный номер кредитной организации	Порядковый номер филиала кредитной организации	Код валюты счета	Вид банковского счета (расчетный, другие счета)	Сумма денежных средств, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Рейтинг долгосрочной кредитоспособности кредитной организации, а также указание на то, кем он присвоен	Кредитная организация является аффилированным лицом управляющей компании (да/нет)
--------------	---	----------------------------	---	--	------------------	---	----------------------------------	--	--	---

1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
Итого	x	x	x	x	x	x	0,00	0,00	x	x

01.02. Денежные средства на счетах по депозиту в кредитных организациях

Таблица: 01.02. Денежные средства на счетах по депозиту в кредитных организациях

Номер строки	Наименование кредитной организации, в которой открыт счет по депозиту	ОГРН кредитной организации	Регистрационный номер кредитной организации	Порядковый номер филиала кредитной организации	Код валюты счета по депозиту	Дата возврата денежных средств	Сумма денежных средств, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Рейтинг долговой кредитной организации, а также на то, кем он присвоен	Кредитная организация является аффилированным лицом управляющей компании (да/нет)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
Итого	x	x	x	x	x	x	0,00	0,00	x	x

02.01.01. Облигации российских хозяйственных обществ

Таблица: 02.01.01. Облигации российских хозяйственных обществ

Номер строки	Наименование эмитента	ОГРН эмитента	ИНН эмитента	Организационно-правовая форма эмитента	Государственный регистрационный номер (идентификационный номер) выпуска	Код ISIN (если присвоен)	Дата погашения	Количество в составе активов, штук	Стоимость актива, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Рейтинг долгой кредитоспособности выпуска (эмитента, поручителя (гаранта)), а также указание на то, кем он присво	Эмитент является аффилированным лицом управляющей компании (да/нет)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
1	АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО «АЛЬФА-БАНК»	1027700067328	7728168971	АО	4B021101326B	RU000A0JUQA9	30.06.2017	10 700	10 742 800	21,89	Ba2, Moody`s	Нет
2	"Московский Кредитный Банк" ПАО	1027739555282	7734202860	ПАО	41101978B	RU000A0JTF50	05.06.2018	9 700	9 506 000	19,37	BB-, S&P	Нет
3	"СИБУР Холдинг" ОАО	1057747421247	7727547261	ОАО	4-10-65134-D	RU000A0JWBK6	17.03.2026	12 500	13 175 000	26,82	Ba1, Moody`s	Нет

4	"Московский Кредитный Банк" ПАО	1027739555282	7734202860	ПАО	4B020901978B	RU000A0JU898	25.03.2020	450	454729,5	0,93	BB-, S&P	Нет
5	"Сбербанк России" ПАО	1027700132195	7707083893	ПАО	4B023701481B	RU000A0JWUE9	30.09.2021	494	499231,46	1,02	Ba1, Moody's	Нет
6	Банк "Финансовая Корпорация Открытие" ПАО	1027739019208	7706092528	ПАО	4B020602209B	RU000A0JU GW4	28.02.2017	2 642	2 699793,4	5,5	BB-, S&P	Нет
7	Банк "Финансовая Корпорация Открытие" ПАО	1027739019208	7706092528	ПАО	40802209B	RU000A0JQZ T8	28.08.2017	9 790	10 005765,3	20,39	BB-, S&P	Нет
Итого	x	x	x	x	x	x	x	x	47367367,29	96,64	x	x

02.01.02. Государственные ценные бумаги Российской Федерации

Таблица: 02.01.02. Государственные ценные бумаги Российской Федерации

Номер строки	Наименование эмитента	ОГРН эмитента	ИНН эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска	Код ISIN (если присвоен)	Дата погашения	Количество в составе активов, штук	Стоимость актива, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Рейтинг долговой кредитоспособности выпуска (эмитента, поручителя (гаранта)), а также указание на то, кем он	Эмитент является аффилированным лицом управляющей компании (да/нет)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
Итого	х	х	х	х	х	х	х	0,00	0,00	х	х

02.01.03. Государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации

Таблица: 02.01.03. Государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации

Номер строки	Наименование эмитента	Наименование субъекта Российской Федерации, от имени которого выпущены ценные бумаги	ОГРН эмитента	ИНН эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска	Код ISIN (если присвоен)	Дата погашения	Количество в составе активов, штук	Стоимость актива, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Рейтинг долгой кредитоспособности выпуска (эмитента, поручителя (гаранта)), а также указание на то, кем он присво	Эмитент является аффилированным лицом управляющей компании (да/нет)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Итого	х	х	х	х	х	х	х	х	0,00	0,00	х	х

02.01.04. Муниципальные ценные бумаги

Таблица: 02.01.04. Муниципальные ценные бумаги

Номер строки	Наименование эмитента	Наименование муниципального образования, от имени которого выпущены ценные бумаги, согласно уставу муниципального образования	ОГРН эмитента	ИНН эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска	Код ISIN (если присвоен)	Дата погашения	Количество в составе активов, штук	Стоимость актива, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Рейтинг долгой кредитоспособности выпуска (эмитента, поручителя (гаранта)), а также указание на то, кем он присвоен	Эмитент является аффилированным лицом управляющей компании (да/нет)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Итого	х	х	х	х	х	х	х	х	0,00	0,00	х	х

02.01.05. Облигации иностранных коммерческих организаций

Таблица: 02.01.05. Облигации иностранных коммерческих организаций

Номер строки	Наименование эмитента	Код государства регистрации (инкорпорации) эмитента	TIN эмитента	Регистрационный номер выпуска	Код ISIN (если присвоен)	Дата погашения	Количество в составе активов, штук	Стоимость актива, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Рейтинг долговой кредитоспособности выпуска (эмитента, поручителя (гаранта)), а также указание на то, кем он	Эмитент является аффилированным лицом управляющей компании (да/нет)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
Итого	x	x	x	x	x	x	x	0,00	0,00	x	x

02.01.06. Облигации иностранных государств

Таблица: 02.01.06. Облигации иностранных государств

Номер строки	Наименование эмитента	Код государства регистрации (инкорпорации) эмитента	TIN эмитента	Регистрационный номер выпуска	Код ISIN (если присвоен)	Дата погашения	Количество в составе активов, штук	Стоимость актива, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Рейтинг долговой кредитоспособности выпуска (эмитента, поручителя (гаранта)), а также указание на то, кем он	Эмитент является аффилированным лицом управляющей компании (да/нет)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
Итого	x	x	x	x	x	x	x	0,00	0,00	x	x

02.01.07. Облигации международных финансовых организаций

Таблица: 02.01.07. Облигации международных финансовых организаций

Номер строки	Наименование эмитента	TIN эмитента	Регистрационный номер выпуска	Код ISIN (если присвоен)	Дата погашения	Количество в составе активов, штук	Стоимость актива, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Рейтинг долговой кредитоспособности выпуска (эмитента, поручителя (гаранта)), а также указание на то, кем он присвоен	Эмитент является аффилированным лицом управляющей компании (да/нет)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
Итого	x	x	x	x	x	x	0,00	0,00	x	x

02.02.01. Акции российских акционерных обществ

Таблица: 02.02.01. Акции российских акционерных обществ

Номер строки	Наименование эмитента	ОГРН эмитента	ИНН эмитента	Организационно-правовая форма эмитента	Государственный регистрационный номер (идентификационный номер) выпуска	Код ISIN (если присвоен)	Категория (тип) акций	Количество в составе активов, штук	Стоимость актива, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Наименование российской биржи, в которых включены	Эмитент является аффилированным лицом управляющей компании (да/нет)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
1	ПАО "Федеральная гидроэнергетическая компания - РусГидро"	1042401810494	2460066195	ПАО	1-01-55038-Е	RU000A0JPKH7	обыкновенные	1 787 474	1 648 051,03	3,36	Московская биржа	Нет
Итого	х	х	х	х	х	х	х	х	1 648 051,03	3,36	х	х

02.02.02. Акции иностранных акционерных обществ

Таблица: 02.02.02. Акции иностранных акционерных обществ

Номер строки	Наименование эмитента	Код государства регистрации (инкорпорации) эмитента	TIN эмитента	Регистрационный номер выпуска	Код ISIN (если присвоен)	Количество в составе активов, штук	Стоимость актива, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Наименование российской биржи, в котировальном списке первого (высшего) уровня которой включены акции	Эмитент является аффилированным лицом управляющей компании (да/нет)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
Итого	х	х	х	х	х	х	0,00	0,00	х	х

03. Недвижимое имущество

Таблица: 03. Недвижимое имущество

Номер строки	Кадастровый номер объекта (если имеется)	Вид объекта	Назначение объекта недвижимости	Код государства, территории которого располагается объект недвижимости	Адрес (местоположение) объекта	Общая стоимость актива, в рублях	Стоимость актива, принятая к расчету собственных средств, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Полное наименование организации, с которой заключен договор об оценке	ИНН организации	Фамилия, имя, отчество (при наличии последнего)	Полное наименование организации, составившей отчет об оценке
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Итого	x	x	x	x	x	0,00	0,00	0,00	x	x	x	x

04. Дебиторская задолженность

Таблица: 04. Дебиторская задолженность

Номер строки	Вид (описание) задолженности	Основание возникновения задолженности	Дата окончания срока погашения задолженности	Наименование должника	Местонахождение должника	ОГРН (ТIN) должника по договору	Сумма задолженности, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Рейтинг должника, а также указание на то, кем он присвоен	Должник является аффилированным лицом управляющей компании (да/нет)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11

1	начисленный накопленный купонный доход	начисление НКД	30.03.2017	"Сбербанк России" ПАО	117997, г. Москва, ул. Вавилова, д. 19	1027700132195	8 264,62	0,02	Ba1, Moody's	Нет
2	начисленный накопленный купонный доход	начисление НКД	28.03.2017	"СИБУР Холдинг" ОАО	626150, Тюменская обл, г. Тобольск, тер. Восточный Промышленный Район, квартал 1-Й, д. 6 корп. 30	1057747421247	341 625	0,7	Ba1, Moody's	Нет
Итого	x	x	x	x	x	x	349 889,62	0,72	x	x

Расшифровки строки 06 подраздела «Обязательства»

06.01. Кредиторская задолженность (кредитор – физическое лицо)

Таблица: 06.01. Кредиторская задолженность (кредитор – физическое лицо)

Номер строки	Вид (описание) задолженности	Основание возникновения задолженности	Дата окончания срока погашения задолженности	Фамилия, имя, отчество (при наличии последнего) кредитора	Сведения о документе, удостоверяющем личность кредитора	Сумма задолженности, в рублях	Доля от общей величины обязательств, в процентах
1	2	3	4	5	6	7	8
Итого	x	x	x	x	x	434 569,77	37,42

06.02. Кредиторская задолженность (кредитор – юридическое лицо)

Таблица: 06.02. Кредиторская задолженность (кредитор – юридическое лицо)

Номер строки	Вид (описание) задолженности	Основание возникновения задолженности	Дата окончания срока погашения задолженности	Наименование кредитора	Место нахождения кредитора	ОГРН (ТIN) кредитора по договору	Сумма задолженности, в рублях	Доля от общей величины обязательств, в процентах
1	2	3	4	5	6	7	8	9
4	оплата информационно-консультационных услуг	оплата поставщикам информационных услуг	20.01.2017	ООО "ИНФИН ИТУМ Консалтинг"	г. Москва, ул. Шаболовка, д. 31, корп. Б	1137746772393	133 400	30,2
Итого	х	х	х	х	х	х	133 400,00	30,20

06.03. Иные обязательства

Таблица: 06.03. Иные обязательства

Номер строки	Вид (описание) обязательства	Основание возникновения обязательства	Размер обязательства, в рублях	Доля от общей величины обязательств, в процентах
1	2	3	4	5
1	оценочные обязательства по вознаграждениям	ПБУ 8/2010, утвержденное Приказом МФ РФ от 13.12.2010 №167н	245 943,59	55,68
2	оценочные обязательства по страховым взносам	ПБУ 8/2010, утвержденное Приказом МФ РФ от 13.12.2010 №167н	62 366,36	14,12
Итого	х	х	308 309,95	69,80

Пояснительная записка к справке о стоимости чистых активов

1. Сведения об активах, принятых к расчету собственных средств, которые переданы в доверительное управление : Нет
2. Сведения об обязательствах по сделкам, заключённым в рамках доверительного управления, принятых к расчету собственных средств: Нет
3. Сведения о событиях, в результате которых в течение отчетного месяца размер собственных средств изменился более чем на 10% : Нет
4. Иная информация: Нет

