

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: 31.10.2016

Предыдущая отчетная дата: 30.09.2016

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	48 194 022.24	0.00
в том числе:			
облигации – всего	02.01	46 797 468.80	0.00
в том числе:			
облигации российских хозяйственных обществ	02.01.01	46 797 468.80	0.00
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	1 396 553.44	0.00
в том числе:			

российских акционерных обществ	02.02.01	1 396 553.44	0.00
иностраннных акционерных обществ	02.02.02	0.00	0.00
Недвижимое имущество	03	0.00	0.00
Дебиторская задолженность	04	260 928.80	0.00
Общая стоимость активов (сумма строк 01 + 02 + 03 + 04)	05	48 454 951.04	0.00
Подраздел «Обязательства»			
Общая величина обязательств	06	909 160.20	0.00
Размер собственных средств			
Размер собственных средств			
(разность строк 05 - 06)	07	47 545 790.84	0.00
Минимальный размер собственных средств			
Минимальный размер собственных средств	08	10 000 000.00	0.00
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 долговой 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	х	х	х	х	х	х	0.00	0.00	х	х

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 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	х	х	х	х	х	х	0.00	0.00	х	х

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 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	12	13
1	АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО «АЛЬФА-БАНК»	1027700067328	7728168971	АО	4B021101326B	RU000A0JUQA9	30.06.2017	7 700	7 818 255	16,14	Ba2, Moody's	Нет
2	"Московский Кредитный Банк" ПАО	1027739555282	7734202860	ПАО	41101978B	RU000A0JTF50	05.06.2018	9 700	9 688 360	19,99	BB-, S&P	Нет

3	"СИБ УР Холди нг" ОАО	105774 742124 7	77275 47261	ОАО	4-10- 65134- D	RU000 A0JW BK6	17.03. 2026	12 500	13 062 500	26,96	Ba1, Moody `s	Нет
4	"Акции онерна я финан совая корпо рация "Систе ма" ОАО	102770 000389 1	77031 04630	ОАО	4-03- 01669- A	RU000 A0JQL 30	24.11. 2016	3 390	3 434 534,4	7,09	BB, S&P	Нет
5	"Моск овский Креди тный Банк" ПАО	102773 955528 2	77342 02860	ПАО	4B020 90197 8B	RU000 A0JU8 98	25.03. 2020	450	455 133,14	0,94	BB- S&P	Нет
6	"Сбер банк Росси и" ПАО	102770 013219 5	77070 83893	ПАО	4B023 70148 1B	RU000 A0JW UE9	30.09. 2021	500	503 492,5	1,03	Ba1, Moody `s	Нет
7	Банк "Фина нсовая Корпо рация Откры тие" ПАО	102773 901920 8	77060 92528	ПАО	4B020 60220 9B	RU000 A0JU GW4	28.02. 2017	1 800	1 838 424,91	3,79	BB- S&P	Нет
8	Банк "Фина нсовая Корпо рация Откры тие" ПАО	102773 901920 8	77060 92528	ПАО	40802 209B	RU000 A0JQZ T8	28.08. 2017	9 790	9 996 768,85	20,63	BB- S&P	Нет
Итого	x	x	x	x	x	x	x	x	46 797 468.80	96.58	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 долгосрочной 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

02.01.03. 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 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

02.01.04. 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 котировальном списке первоого (высшего) уровня которой 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-E	RU000A0JPKH7	обыкновенные	1 787 474	1 396 553,44	2,88	Московская биржа	Нет
Итого	х	х	х	х	х	х	х	х	1 396 553,44	2,88	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	x	x	x	x	x	x	0.00	0.00	x	x

03. Недвижимое имущество

Таблица: 03. Недвижимое имущество

Номер строки	Кадастровый номер объекта (если имеется)	Вид объекта	Назначение объекта недвижимости	Код государства, на 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 положительное экспертное заключение на 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 долгосрочной кредитоспособности 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	проспект эмиссии	30.12.2016	АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО «АЛЬФА-БАНК»	107078, г. Москва, ул. Каланчевская, д. 27	1027700067328	186 203	0,38	Ba2, Moody's	Нет
2	начисленный накопленный купонный доход	проспект эмиссии	24.11.2016	"Акционерная финансовая корпорация "Система"	125009, г. Москва, ул. Моховая, д. 13 стр. 1	1027700003891	74 725,8	0,15	BB, S&P	Нет
Итого	x	x	x	x	x	x	260 928.80	0.54	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
1	заработная плата за октябрь 2016 года	начисление заработной платы	10.11.2016	XXXXXX	XXXXXX	25 276,19	2,78
2	заработная плата за октябрь 2016 года	начисление заработной платы	10.11.2016	XXXXXX	XXXXXX	34 742,58	3,82

3	заработная плата за октябрь 2016 года	начисление заработной платы	10.11.2016	XXXXXX	XXXXXX	54 659,76	6,01
4	заработная плата за октябрь 2016 года	начисление заработной платы	10.11.2016	XXXXXX	XXXXXX	94 785,71	10,43
5	заработная плата за октябрь 2016 года	начисление заработной платы	10.11.2016	XXXXXX	XXXXXX	40 125,95	4,41
6	заработная плата за октябрь 2016 года	начисление заработной платы	10.11.2016	XXXXXX	XXXXXX	31 595,24	3,48
7	заработная плата за октябрь 2016 года	начисление заработной платы	10.11.2016	XXXXXX	XXXXXX	87 202,86	9,59
8	заработная плата за октябрь 2016 года	начисление заработной платы	10.11.2016	XXXXXX	XXXXXX	87 202,86	9,59
9	заработная плата за октябрь 2016 года	начисление заработной платы	10.11.2016	XXXXXX	XXXXXX	25 276,19	2,78
10	заработная плата за октябрь 2016 года	начисление заработной платы	10.11.2016	XXXXXX	XXXXXX	18 507,24	2,04
Итого	x	x	x	x	x	499 374.58	54.93

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 (TIN) кредитора по договору	Сумма задолженности, в рублях	Доля от общей величины обязательств, в процентах
1	2	3	4	5	6	7	8	9
1	начисленные взносы с заработной платы за октябрь 2016 года	начисление заработной платы	10.11.2016	ГУ - МОСКОВСКОЕ РО ФОНДА СОЦИАЛ ЬНОГО СТРАХОВАНИЯ РОССИЙ СКОЙ ФЕДЕРА ЦИИ	127006,Г ОРОД МОСКВА ,БУЛЬВА Р СТРАСТ НОЙ,ДО М 7,СТРОЕ НИЕ 1	10277005 32298	8 839,46	0,96
2	начисленные взносы с заработной платы за октябрь 2016 года	начисление заработной платы	10.11.2016	ГУ – Отделени е Пенсионн ого фонда РФ по г. Москве и Московск ой области	125009,Г ОРОД МОСКВА ,БУЛЬВА Р ТВЕРСК ОЙ,18,1	10277030 26075	174 198,6	19,16
3	начисленн ый НДФЛ с заработной платы за октябрь 2016 года	начислен ие заработной платы	10.11.2016	ИФНС России № 28 по г.Москве	117292,Г ОРОД МОСКВА ,УЛИЦА ИВАНА БАБУШК ИНА,ДО М 10	10477280 58311	102 054	11,23
4	оплата информационно-консультационных услуг	оплата поставщи кам информацион ных услуг	15.11.2016	ООО "ИНФИН ИТУМ Консалти нг"	г. Москва, ул. Шаболовк а, д. 31, корп. Б	11377467 72393	124 793,56	13,73
Итого	х	х	х	х	х	х	409 785.62	45.07

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
Итого	х	х	0.00	0.00

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

Сопроводительное письмо

Код территории по ОКАТО: 45902000

Идентификационный номер налогоплательщика (ИНН): 7710261440

Основной государственный регистрационный номер (ОГРН): 1027700160234

Полное наименование организации: Акционерное общество "Управляющая компания "Стратегия"

Сокращенное наименование организации: АО "Управляющая компания "Стратегия"

Отчетный месяц: октябрь

Отчетный год: 2016

Дата исходящего документа: 11.11.2016

Краткое содержание письма: расчет собственных средств на 31.10.2016

Исходящий номер: 793

Руководитель управляющей компании

Фамилия: Жибицкий

Имя: Дмитрий

Отчество: Ильич

Должность: Генеральный директор

Контактный телефон: (495) 407-08-59

В случае, если отчетность подписывается электронной подписью лица, временно исполняющего обязанности единоличного исполнительного органа, внести реквизиты документа, являющегося основанием исполнения обязанностей единоличного исполнительного органа: Нет

Дата

М.П.

ННЫХ ФОНДОВ И НЕГОСУДАРСТВЕННЫХ ПЕНСИОННЫХ ФОНДОВ