

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: 31.01.2017

Предыдущая отчетная дата: 31.12.2016

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	48 731 370,69	48 731 370,69
в том числе:			
облигации – всего	02.01	47 083 319,66	47 083 319,66
в том числе:			
облигации российских хозяйственных обществ	02.01.01	47 083 319,66	47 083 319,66
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	1 648 051,03
в том числе:			

российских акционерных обществ	02.02.01	1 648 051,03	1 648 051,03
иностраных акционерных обществ	02.02.02	0,00	0,00
Недвижимое имущество	03	0,00	0,00
Дебиторская задолженность	04	465 307,06	349 889,62
Общая стоимость активов (сумма строк 01 + 02 + 03 + 04)	05	49 196 677,75	49 081 260,31
Подраздел «Обязательства»			
Общая величина обязательств	06	1 485 386,62	441 709,95
Размер собственных средств			
Размер собственных средств			
(разность строк 05 - 06)	07	47 711 291,13	48 639 550,36
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 долговой 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 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	10 700	10 742 800	21,84	Ba2, Moody's	Нет
2	"Московский Кредитный Банк" ПАО	1027739555282	7734202860	ПАО	41101978B	RU000A0JTF50	05.06.2018	9 700	9 506 000	19,32	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	13 175 000	26,79	Ba1, Moody `s	Нет
4	"Моск овский Креди тный Банк" ПАО	102773 955528 2	77342 02860	ПАО	4B020 90197 8B	RU000 A0JU8 98	25.03. 2020	450	454 729,5	0,92	BB- S&P	Нет
5	"Сбер банк Росси и" ПАО	102770 013219 5	77070 83893	ПАО	4B023 70148 1B	RU000 A0JW UE9	30.09. 2021	494	499 231,46	1,01	Ba1, Moody `s	Нет
6	Банк "Фина нсовая Корпо рация Откры тие" ПАО	102773 901920 8	77060 92528	ПАО	4B020 60220 9B	RU000 A0JU GW4	28.02. 2017	2 642	2 699 793,4	5,49	BB- S&P	Нет
7	Банк "Фина нсовая Корпо рация Откры тие" ПАО	102773 901920 8	77060 92528	ПАО	40802 209B	RU000 A0JQZ T8	28.08. 2017	9 790	10 005 765,3	20,34	BB- S&P	Нет
Итого	x	x	x	x	x	x	x	x	47 083 319,66	95,71	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	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 долгосрочной 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	х	х	х	х	х	х	х	0,00	0,00	х	х

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	х	х	х	х	х	х	х	0,00	0,00	х	х

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-Е	RU000A0JPKH7	обыкновенные	1 787 474	1 648 051,03	3,35	Московская биржа	Нет
Итого	х	х	х	х	х	х	х	х	1 648 051,03	3,35	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 оценщика, составившего отчет об оценке)	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	х	х	х	х	х	0,00	0,00	0,00	х	х	х	х

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	начисление НКД	30.03.2017	"Сбербанк России" ПАО	117997, г. Москва, ул. Вавилова, д. 19	1027700132195	12182,06	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	453125	0,92	Ba1, Moody's	Нет
Итого	x	x	x	x	x	x	465307,06	0,94	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	2	3	4	5	6	7	8

1	заработная плата за январь 2016 года	начисление заработной платы	10.02.2017	XXXXXX	XXXXXX	28 917,65	1,95
2	заработная плата за январь 2016 года	начисление заработной платы	10.02.2017	XXXXXX	XXXXXX	43 376,47	2,92
3	заработная плата за январь 2016 года	начисление заработной платы	10.02.2017	XXXXXX	XXXXXX	62 898,41	4,23
4	заработная плата за январь 2016 года	начисление заработной платы	10.02.2017	XXXXXX	XXXXXX	108 441,18	7,3
5	заработная плата за январь 2016 года	начисление заработной платы	10.02.2017	XXXXXX	XXXXXX	45 906,76	3,09
6	заработная плата за январь 2016 года	начисление заработной платы	10.02.2017	XXXXXX	XXXXXX	36 147,06	2,43
7	заработная плата за январь 2016 года	начисление заработной платы	10.02.2017	XXXXXX	XXXXXX	99 765,88	6,72
8	заработная плата за январь 2016 года	начисление заработной платы	10.02.2017	XXXXXX	XXXXXX	99 765,88	6,72
9	заработная плата за январь 2016 года	начисление заработной платы	10.02.2017	XXXXXX	XXXXXX	29 281,65	1,97
10	заработная плата за январь 2016 года	начисление заработной платы	10.02.2017	XXXXXX	XXXXXX	21 147,29	1,42
Итого	x	x	x	x	x	575 648,23	38,75

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
1	оплата информационно-консультационных услуг	оплата поставщикам информационно-консультационных услуг	14.02.2017	ООО "ИНФИН ИТУМ Консалтинг"	г. Москва, ул. Шаболовка, д. 31, корп. Б	1137746772393	133 400	8,98
2	начисленные взносы с заработной платы за январь 2017 года	начисление заработной платы	10.02.2017	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	1027700532298	1 590	0,11
3	начисленные взносы с заработной платы за январь 2017 года	начисление заработной платы	10.02.2017	ИФНС России № 28 по г. Москве	117292, Г ОРОД МОСКВА , УЛИЦА ИВАНА БАБУШК ИНА, ДО М 10	1047728058311	238 500	16,06

4	начисленные НДФЛ с заработной платы за январь 2017 года	начисленные заработные платы	10.02.2017	ИФНС России № 28 по г.Москве	117292,Г ОРОД МОСКВА, УЛИЦА ИВАНА БАБУШКИНА, ДОМ 10	1047728058311	102 440	6,9
5	оплата информационно-консультационных услуг	оплата поставщикам информационных услуг	07.02.2017	ООО "ИНФИН ИТУМ Консалтинг"	г. Москва, ул. Шаболовка, д. 31, корп. Б	1137746772393	40 000	2,69
Итого	х	х	х	х	х	х	515 930,00	34,73

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	311 610,59	20,98
2	оценочные обязательства по страховым взносам	ПБУ 8/2010, утвержденное Приказом МФ РФ от 13.12.2010 №167н	82 197,8	5,53
Итого	х	х	393 808,39	26,51

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