

ПАЛЛАДА

управление  
активами

127006, Россия, г. Москва,  
Старопименовский пер., д. 18, этаж 2

тел.: +7 (495) 789-46-89

факс: +7 (495) 721-13-58

www.pallada.ru

ИНН 7710199697 КПП 775001001

ОКПО 44504664 ОГРН 1027739145060

11/03/2014 № 387

НП СРО «МЦПУ»

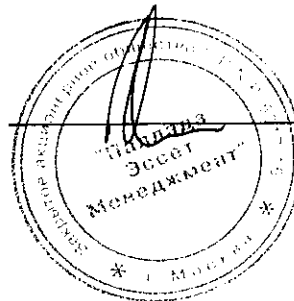
**СВЕДЕНИЯ О ФИНАНСОВЫХ РЕЗУЛЬТАТАХ  
ЗА ФЕВРАЛЬ 2014 ГОДА.**

ЗАО "ПАЛЛАДА" в соответствии с договором доверительного управления средствами компенсационного фонда от № 171212/1 от 17 декабря 2012 года и со статьей 276 НК РФ направляет сведения о финансовых результатах.

Приложения:

- Инвестиционный портфель на 28 февраля 2014 года;
- Оборотно-сальдовая ведомость за февраль 2014 года;
- Налоговый регистр по процентным доходам по ценным бумагам (15%) за февраль 2014 года;
- Карточка счета 51 «Расчетный счет» за февраль 2014 года;
- Отчет о деятельности по ДУ за февраль 2014 года.

Заместитель генерального директора



М.А. Имаметдинов

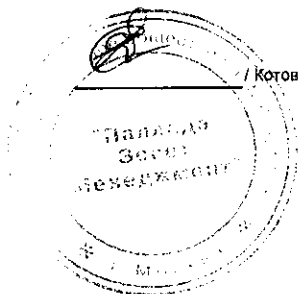
Дата:

Подпись: \_\_\_\_\_

ЗАО "Паллада" Д.У. средствами компенсационного фонда НП СРО "МЦПУ"  
 Отчет об инвестиционном портфеле по оценочной стоимости  
 28.02.2014

Наименование ценной бумаги	Количество ценных бумаг в портфеле фонда	Цена оценочная	Стоимость оценочная, руб	Купон	Стоимость оценочная НКД, руб	Итого стоимость
ОФЗ-25071-ПД	1 000	1 013,23200	1 013 232,00	20,64	20 640,00	1 033 872,00
ОФЗ-25077-ПД	100	1 009,30100	100 930,10	7,45	745,00	101 675,10
ОФЗ-25079-ПД	2 901	1 006,88500	2 920 973,39	16,49	47 837,49	2 968 810,88
ОФЗ-26202-ПД	1 000	1 040,00000	1 040 000,00	22,09	22 090,00	1 062 090,00
ОФЗ-26211-ПД	550	932,87400	513 080,70	4,41	2 425,50	515 506,20
<b>Итого Облигация</b>	<b>5 551</b>		<b>5 588 216,19</b>		<b>93 737,99</b>	<b>5 681 954,18</b>

Исполнитель



/ Котова Е.Н. /

Оборотно-сальдовая ведомость

Период: Февраль 2014 г.

Выводимые данные: сумма

Код	Счет Наименование	Сальдо на начало периода		Оборот за период		Сальдо на конец периода	
		Дебет	Кредит	Дебет	Кредит	Дебет	Кредит
51	Расчетные счета	602 966,23			521 051,31	81 914,92	
55	Специальные счета в банках	11 422 440,51		175 305,76		11 597 746,27	
55.03	Депозитные счета	3 750 000,00				3 750 000,00	
55.23	Депозитные счета (в валюте)	7 672 440,51		175 305,76		7 847 746,27	
58	Финансовые вложения	3 985 930,07		1 654 629,18		5 640 559,25	
58.02	Долговые ценные бумаги	4 054 313,91		1 638 712,68		5 693 026,59	
58.08	Переоценка ценных бумаг	-68 383,84				-68 383,84	
58.08.1	Переоценка тела долговых ценных бумаг	-68 383,84				-68 383,84	
58.21	НКД			15 916,50		15 916,50	
76	Расчеты с разными дебиторами и кредиторами	1 330 236,20		522 413,88	1 654 793,02	197 857,06	
76.03	Расчеты по причитающимся дивидендам и другим доходам	122 285,96				122 285,96	
76.03.1	Расчеты по причитающимся дивидендам	122 285,96				122 285,96	
76.05	Расчеты с прочими поставщиками и подрядчиками		21 031,31	21 031,31			
76.08	Расчеты по ценным бумагам	1 156 625,24		500 000,00	1 654 629,18	1 996,06	
	Прспект ИК	1 156 625,24		500 000,00	1 654 629,18	1 996,06	
	200213/3 от 20.02.2013	1 156 625,24		500 000,00	1 654 629,18	1 996,06	
76.58	Комиссия биржи до даты регистрации			163,84	163,84		
76.19	Дооценка НКД	19 017,18				19 017,18	
76.23	Расчеты по причитающимся дивидендам и другим доходам (в валюте)	53 339,13		1 218,73		54 557,86	
79	Внутрихозяйственные расчеты		16 390 550,00				16 390 550,00
79.03	Расчеты по договору доверительного управления имуществом		16 390 550,00				16 390 550,00
84	Нераспределенная прибыль (непокрытый убыток)		399 594,96				399 594,96
84.01	Прибыль, подлежащая распределению		399 594,96				399 594,96
91	Прочие доходы и расходы			176 524,49	176 524,49		
91.01	Прочие доходы		551 428,05		176 524,49		727 952,54
91.02	Прочие расходы			20,00		20,00	
91.09	Сальдо прочих доходов и расходов	551 428,05		176 504,49		727 932,54	
99	Прибыли и убытки		551 428,05		176 504,49		727 932,54
99.01	Прибыли и убытки (за исключением налога на прибыль)		551 428,05		176 504,49		727 932,54
99.01.1	Прибыли и убытки по деятельности, не облагаемой ЕНВД		551 428,05		176 504,49		727 932,54
		17 341 573,01	17 341 573,01	2 528 873,31	2 528 873,31	17 518 077,50	17 518 077,50



Закрытое акционерное общество "Паллада Эссет Менеджмент" 7710198697

Аналитический регистр налогового учета по процентному доходу по ценным бумагам, условиями выпуска и обращения которых предусмотрено получение дохода в виде процентов, облагаемых по ставке 15.

По ДУ\_НП СРО МЦПУ

Период: Февраль 2014 г.

Дата составления регистра

Составлено исходя из положений НК РФ (часть II) в его редакции от 31.12.2002 г.

НКД	Сальдо на 01.02.2014		Оплачено за НКД в течение			Доходы			Начисленный (не выплаченный) купонный доход на 28.02.2014	Прибыль	
	Количество	Начисленный (не выплаченный) купонный доход	Количество	Дата	Балансовая (уплаченная) стоимость НКД	Количество	Дата	Получено купонного дохода при его очередной выплате			Получено купонного дохода при реализации или погашении ц/б
ОФЗ-25071-ПД			1 000,00	05.02.2014	15 530,00					20 640,00	5 110,00
ОФЗ-25077-ПД			100,00	05.02.2014	282,00					745,00	463,00
ОФЗ-25079-ПД	2 901	32 259,12								47 837,49	15 578,37
ОФЗ-26202-ПД	1 000	13 500,00								22 090,00	8 590,00
ОФЗ-26211-ПД			550,00	06.02.2014	104,50					2 425,50	2 321,00
<b>Итого</b>	<b>3 901,00</b>	<b>45 759,12</b>	<b>1 650,00</b>		<b>15 916,50</b>					<b>93 737,99</b>	<b>32 062,37</b>
<b>Сумма налога 15.%</b>											<b>4 809,00</b>

Исполнитель



/ Котова Е.Н. /

**Карточка счета 51**  
 Период: Февраль 2014 г.

Дата	Документ	Операция	Дебет		Кредит		Текущее сальдо
			Счет	Сумма	Счет	Сумма	
Сальдо на начало				602 966,23		0,00	
05.02.2014	Платежное поручение исходящее МЦП00000001 от 05.02.2014 14:52:58	Перевод брокеру по договору 200213/3 от 20.02.2013 на покупку ЦБ Сумма 500000-00 НДС(18%) 0-00 Перспект ИК 200213/3 от 20.02.2013 ММВБ_АКЦ_Ф ОАО "МЕЖТОПЭНЕРГОБАН К" (Расчетный) Перевод ДС брокеру	76.08		51	500 000,00	102 966,23 Д
05.02.2014	Платежное поручение исходящее МЦП00000002 от 05.02.2014 14:52:59	Оплата по договору Сумма 20-00 НДС(18%) 0-00 Услуги банка ОАО "МЕЖТОПЭНЕРГОБАН К" (Расчетный) Комиссии банка	91.02		51	20,00	102 946,23 Д
14.02.2014	Платежное поручение исходящее МЦП00000003 от 14.02.2014 15:51:17	Оплата по договору Сумма 21031-31 НДС(18%) 0-00 Паллада 280610/1 от 28.06.2010 ОАО "МЕЖТОПЭНЕРГОБАН К" (Расчетный) Оплата поставщику	76.05		51	21 031,31	81 914,92 Д
Обороты за период				0,00		521 051,31	
Сальдо на конец				81 914,92		0,00	

Исполнитель:



Котова Елена Николаевна

Отчет о деятельности по доверительному управлению

05.03.2014 12:22

Отчетный период с 01.02.2014 по 28.02.2014

Клиент: НП СРО "МЦПУ"

Договор доверительного управления № 171212/1

1. Оценочная стоимость имущества:

Активы	Стоимость активов		Стоимость активов	
	на дату начала отчетного периода	% от активов	на дату окончания отчетного периода	% от активов
Денежные средства с учетом обязательств	1 730 560,18	10,01 %	83 910,98	0,48 %
Итого числ:	денежные средства	1 759 591,47	83 910,98	
	обязательства	-21 031,31	-	
Акции	-	-	-	-
Облигации	4 005 385,88	23,06 %	8 881 954,18	32,30 %
Незамоскворские ЦБ	-	-	-	-
Прочие финансовые инструменты	11 624 524,37	66,93 %	11 825 301,53	67,22 %
Срочные контракты	-	-	-	-
<b>ВСЕГО :</b>	<b>17 388 450,41</b>	<b>100,00 %</b>	<b>17 591 188,89</b>	<b>100,00 %</b>

2. Портфель ЦБ на дату окончания отчетного периода

Вид ЦБ	Наименование ЦБ	Номер гос. регистрации ЦБ	Количество ЦБ, шт				Средняя цена покупки, руб	Собственность, руб	Рыночная цена на конец отчетного периода, руб	Оценочная стоимость на конец отчетного периода, руб	Переоценка, руб	Изменение рыночной цены за отчетный период, %	Доля в структуре активов, %
			на начало отчетного периода	зачислено	списано	на конец отчетного периода							
Депозит	Депозит «Авангард» № 1901 от 05.06.13 г.	Депозит Авангард № 1901 от 05.06.13 г.	1	-	-	1	3 097 828,77	3 087 828,77	3 000 000,00	3 125 712,33	27 883,56	0,90%	17,85%
Депозит	Депозит «Авангард» № 1902 от 05.06.13 г.	Депозит Авангард № 1902 от 05.06.13 г.	1	-	-	1	774 457,19	774 457,19	750 000,00	781 428,08	6 870,89	0,90%	4,46%
Депозит	Депозит «Авангард» № 1903 от 05.06.13 г.	Депозит Авангард № 1903 от 05.06.13 г.	1	-	-	1	7 024 188,67	7 024 189,67	6 875 694,35	7 038 284,53	14 094,86	10,37%	40,20%
Депозит	Депозит «Авангард» № 1904 от 05.06.13 г.	Депозит Авангард № 1904 от 05.06.13 г.	1	-	-	1	878 114,46	878 114,46	872 051,92	879 876,59	1 762,13	10,37%	5,03%
Облигация	Минфин РФ, облигация федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 25071	25071RMFS	-	1 000	-	1 000	1 029 232,7	1 029 232,69	1 013 232	1 033 872,00	4 639,31	0,45%	5,91%
Облигация	Минфин РФ, облигация федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 25077	25077RMFS	-	100	-	100	1 014 222,3	1 014 222,23	1 008 301	1 018 75,10	252,87	0,25%	0,58%
Облигация	Минфин РФ, облигация федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 25078	25078RMFS	2 901	-	-	2 901	1 017 452	2 951 628,25	1 006 865	2 968 810,58	17 182,63	0,58%	15,98%
Облигация	Минфин РФ, облигация федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26202	26202RMFS	1 000	-	-	1 000	1 053 319	1 053 319,00	1 040,00	1 062 090,00	8 771,00	0,83%	6,07%
Облигация	Минфин РФ, облигация федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26211	26211RMFS	-	550	-	550	952 680,5	523 974,28	832,874	515 506,20	-6 465,09	-1,62%	2,94%
<b>Итого</b>			<b>3 902</b>	<b>1 650</b>	<b>-</b>	<b>5 555</b>		<b>17 434 166,52</b>		<b>17 507 255,71</b>	<b>73 089,19</b>	<b>4,73%</b>	<b>100,00%</b>

3. Информация об операциях по передаче/выводу объектов влн ДУ в отчетном периоде

4. Информация о сделках и операциях с ЦБ, совершенных в отчетном периоде

Вид ЦБ: Облигация  
 Эмитент: Министерство Финансов РФ  
 Тип ЦБ: Облигация с фиксированным доходом  
 Тикер: Минфин РФ, облигация федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 25071  
 № гос. регистрации: 25071RMFS

Площадка	Дата и время	Вид сделки	Дата оплаты		Дата поставки		Кол-во	Цена в вал. сделке	Сумма в вал. сделке	Вал	Цена в руб.	Сумма в руб.	НКД	Комиссия брокера	Комиссия биржи	Контрагент	Место заключения сделки	Режим торгов	MAX цена ЦБ	MIN цена ЦБ
			план	факт	план	факт														
Биржи	05.02.14 15:23:24	Покупка	05.02.14	05.02.14	05.02.14	05.02.14	1 000	1 013,50	1 013 500,00 руб	1 013,50	1 013 500,00	15 530,00	101,35	101,34	MMBS	MMBS_#ЦБ	EQOB	1 014,50	1 012,50	

Вид ЦБ: Облигация  
 Эмитент: Министерство Финансов РФ  
 Тип ЦБ: Облигация с фиксированным доходом  
 Тикер: Минфин РФ, облигация федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 25077  
 № гос. регистрации: 25077RMFS

Площадка	Дата и время	Вид сделки	Дата оплаты		Дата поставки		Кол-во	Цена в вал. сделке	Сумма в вал. сделке	Вал	Цена в руб.	Сумма в руб.	НКД	Комиссия брокера	Комиссия биржи	Контрагент	Место заключения сделки	Режим торгов	MAX цена ЦБ	MIN цена ЦБ
			план	факт	план	факт														
Биржи	05.02.14 10:56:46	Покупка	05.02.14	05.02.14	05.02.14	05.02.14	100	1 011,20	101 120,00 руб	1 011,20	101 120,00	282,00	10,11	10,12	MMBS	MMBS_#ЦБ	EQOB	1 014,00	1 011,20	

Вид ЦБ: Облигация  
 Эмитент: Министерство Финансов РФ  
 Тип ЦБ: Облигация с фиксированным доходом  
 Тикер: Минфин РФ, облигация федерального займа с постоянным купонным доходом, документарные именные, выпуск 26211  
 № гос. регистрации: 26211RMFS

Площадка	Дата и время	Вид сделки	Дата оплаты		Дата поставки		Кол-во	Цена в вал. сделке	Сумма в вал. сделке	Вал	Цена в руб.	Сумма в руб.	НКД	Комиссия брокера	Комиссия биржи	Контрагент	Место заключения сделки	Режим торгов	MAX цена ЦБ	MIN цена ЦБ
			план	факт	план	факт														
Биржи	06.02.14 10:00:12	Покупка	06.02.14	06.02.14	06.02.14	06.02.14	550	852,30	523 765,00 руб	852,30	523 765,00	104,30	52,38	52,36	MMBS	MMBS_#ЦБ	EQOB	-	-	

6. Сведения о сделках, приведших к нарушению инвестиционной декларации

Дата сделки	Номер сделки	Тип сделки	Описание сделки
1	2	3	4

6. Сведения о сделках с ценными бумагами, совершенных в отчетном периоде на заведомо худших условиях по сравнению с рыночными

Дата сделки	Номер сделки	Тип сделки	Описание сделки
1	2	3	4

7. Сведения об изменениях во внутренних документах доверительного управляющего, подлежащих ознакомлению учредителем управления при подписании договора ДУ

Описание изменений во внутренних документах

8. Сведения о движении денежных средств и расходах, связанных с доверительным управлением, произведенных в отчетном периоде

Дата	Операция	Сумма		Дата начисления	Наименование документа
		Приход	Расход		
05.02.2014	Покупка		101 412,11 руб	05.02.2014	Покупка №1.002689
06.02.2014	Покупка		1 029 131,35 руб	05.02.2014	Покупка №1.002684
05.02.2014	Перемещение ДС	500 000,00 руб	500 000,00 руб	05.02.2014	Перемещение ДС с р/с Д-2014205-0002
05.02.2014			20,00 руб	05.02.2014	Комиссия банка
05.02.2014	Покупка		10,12 руб	05.02.2014	Покупка №1.002689
05.02.2014	Покупка		101,34 руб	05.02.2014	Покупка №1.002684
06.02.2014	Покупка		523 921,88 руб	06.02.2014	Покупка №1.002699
06.02.2014	Покупка		52,35 руб	06.02.2014	Покупка №1.002699
14.02.2014	Вознагр. за эффект.		21 031,31 руб	31.12.2013	Вознагр. за эффект. № НК-2013С31-0015
<b>ИТОГО</b>		<b>500 000,00 руб</b>	<b>2 175 680,49 руб</b>		

8.1. Итого по видам операции

По сделкам юп	Приход	Расход
<b>Группа СТАТЬИ РАСХОДОВ</b>		
Услуги банка	-	20,00 руб
<b>Группа ПРОЧИЕ СТАТЬИ</b>		
<b>Группа Вознаграждения за эффективность</b>		
Группа Комиссия за эффективность за 2013		
Комиссия за эффективность за 2013	-	21 031,31 руб
<b>Группа ВИДЫ ОПЛАТ</b>		
Оплата основной суммы сделки	-	1 638 385,00 руб
Оплата купона по сделке	-	15 618,50 руб
<b>Группа Оплата комиссий</b>		
Комиссия брокера	-	163,84 руб
Комиссия брокера	-	163,84 руб
Перемещение ДС с р/с	500 000,00 руб	500 000,00 руб
<b>ИТОГО</b>	<b>500 000,00 руб</b>	<b>2 175 680,49 руб</b>

9. Сведения об уменьшении стоимости имущества учредителя управления, находящегося в ДУ, по сравнению со стоимостью имущества в соответствии с последним отчетом

Текст сведений
----------------

10. Сведения о денежных средствах и ценных бумагах которые должны поступить доверительному управляющему после расторжения договора ДУ с учредителем управления в связи с осуществлением управления ЦБ в интересах этого лица

Текст сведений
----------------

Лицо, ответственное за составление отчетности:

Циренко Ю.В.

Руководитель:

Ильинойной М.А.

