

ПОЯСНИТЕЛЬНАЯ ЗАПИСКА
к справке о стоимости чистых активов акционерного инвестиционного фонда
(стоимости чистых активов паевого инвестиционного фонда)
Открытый паевой инвестиционный фонд облигаций "Арикапитал – Чистые деньги"

(полное фирменное наименование акционерного инвестиционного фонда либо тип и название паевого инвестиционного фонда)

далее - паевой инвестиционный фонд

14 марта 2013 г., № 2565, Федеральная служба по финансовым рынкам

(дата регистрации правил доверительного управления паевым инвестиционным фондом федеральным органом исполнительной власти по рынку ценных

Общество с ограниченной ответственностью Управляющая компания "Арикапитал",
 115035, г. Москва, ул. Садовническая, д. 82, стр. 2, т.(495) 225-93-77,

№ 21-000-1-00952, 31 января 2013 г., Федеральная служба по финансовым рынкам

(полное фирменное наименование управляющей компании, место нахождения, номер телефона управляющей компании, номер и дата предоставления лицензии на осуществление деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами и негосударственными

на 30 сентября 2014 г.

1. Настоящая Пояснительная записка составлена в соответствии с Приказом ФСФР от 15 июня 2005 г. N 05-21/пз-н «ОБ УТВЕРЖДЕНИИ ПОЛОЖЕНИЯ О ПОРЯДКЕ И СРОКАХ ОПРЕДЕЛЕНИЯ СТОИМОСТИ ЧИСТЫХ АКТИВОВ АКЦИОНЕРНЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ, СТОИМОСТИ ЧИСТЫХ АКТИВОВ ПАЕВЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ, РАСЧЕТНОЙ СТОИМОСТИ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ПАЕВ ПАЕВЫХ
2. Информация о фактах совершения ошибок, приведших к изменению расчетной стоимости инвестиционного пая паевого инвестиционного фонда на 0,5 и более процентов, а также мерах по исправлению и последствиях
 В 3 квартале 2014 года фактов совершения таких ошибок выявлено не было.
3. Информация о забалансовых рисках паевого инвестиционного фонда, включая информацию о требованиях и обязательствах паевого инвестиционного фонда, не включаемых в расчет стоимости чистых активов, в том числе о требованиях и обязательствах по опционным и фьючерсным контрактам, и об активах, обремененных
 На 30 сентября 2014 года открыты короткие позиции по фьючерсным контрактам:

№	Позиция					Покрытие совокупной короткой позиции				
	Вид инструмента	Наименование, категория (тип), выпуск, транш, серия инструмента	Количество	Количество единиц базового актива, определ. в спецификации срочного контракта	Эмитент (для ценной бумаги)	Оценочная стоимость базовых активов, исходя из их количества во всех срочных контрактах, на дату составления Пояснительной записки, руб.	Вид инструмента	Наименование, категория (тип), выпуск, транш, серия инструмента	Количество	Оценочная стоимость на дату составления Пояснительной записки, руб.
1	фьючерс	Si-12.14 (фьючерсный контракт на курс доллар США – российский рубль) базовый актив - доллар США	2 965	1 000		116 781 269,00	ценные бумаги	Еврооблигация, Kuznetski Capital S.A., ISIN: XS0299183250, дата погашения: 10.05.2017	1 500	56 729 701,58
							ценные бумаги	Еврооблигация, AK BARS LUXEMBOURG S.A., ISIN: XS0855334289, дата погашения: 19.11.2015	300	12 003 854,08
							иностранная валюта	Денежные средства на депозитном счете, "ДЖЕЙ ЭНД ТИ БАНК" (ЗАО), доллар США	1 260 000	49 627 116,00
2	фьючерс	Si-3.15 (фьючерсный контракт на курс доллар США – российский рубль) базовый актив - доллар США	1 450	1 000		57 110 570,00	ценные бумаги	Еврооблигация, AK BARS LUXEMBOURG S.A., ISIN: XS0855334289, дата погашения: 19.11.2015	1 450	58 018 628,07
ИТОГО:						173 891 839,00				176 379 299,73

4. Сведения о событиях, которые оказали существенное влияние на стоимость чистых активов паевого
 - а) сумма объявленных, но не полученных дивидендов по акциям, составляющим активы паевого инвестиционного фонда:

Нет.

б) сумма начисленных, но не полученных доходов по инвестиционным паям закрытых паевых инвестиционных фондов, составляющим активы паевого инвестиционного фонда:

Нет.

в) сумма начисленных, но не полученных платежей по обязательствам (выплат по ипотечным сертификатам участия), требования по которым (которые) составляют ипотечное покрытие, долю в праве общей собственности на которое удостоверяют ипотечные сертификаты участия, составляющие активы паевого

Нет.

г) существенные (на 10 и более процентов за отчетный квартал) изменения признаваемых котировок ценных бумаг, составляющих активы паевого инвестиционного фонда:

Нет.

д) сведения о прочих событиях, которые существенно повлияли на стоимость чистых активов паевого инвестиционного фонда:

В 3 квартале 2014 года существенное увеличение стоимости чистых активов паевого инвестиционного фонда связано с выдачей инвестиционных паев.

За 3 квартал 2014 года оценочная стоимость следующих еврооблигаций, составляющих активы паевого инвестиционного фонда, в расчете на одну ценную бумагу изменилась на 10 и более процентов:

еврооблигация, AK BARS LUXEMBOURG S.A., ISIN:XS0855334289, дата погашения: 19.11.15, изменение +13,73%;

еврооблигация, Sibur Securities Limited, ISIN:XS0878855773, дата погашения: 31.01.18, изменение +11,88%;

еврооблигация, VPB Funding Limited, ISIN: XS0993279958, дата погашения: 14.11.16, изменение +14,31%.

Генеральный директор ООО УК "Арикапитал" _____ / А.В. Третьяков /

Генеральный директор ООО УК "Арикапитал" _____ / А.В. Третьяков /

Уполномоченное лицо

ОАО "Специализированный депозитарий "ИНФИНИТУМ"

Начальник отдела контроля упр-я контр. и сопр. ИФ _____ / Ю.Е. Гриднева /