

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 пенсионными фондами, наименование лицензирующего органа)

на 31 декабря 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 ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ, А ТАКЖЕ СТОИМОСТИ ЧИСТЫХ АКТИВОВ АКЦИОНЕРНЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ В РАСЧЕТЕ НА ОДНУ АКЦИЮ».
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 4 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 31 декабря 2014 года забалансовые риски отсутствуют.
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:
Облигация федерального займа Министерства Финансов Российской Федерации, гос.рег. номер 46022RMFS, серия 46022, изменение: -11,63%.
д) сведения о прочих событиях, которые существенно повлияли на стоимость чистых активов паевого инвестиционного фонда:
В 4 квартале 2014 года существенное уменьшение стоимости активов паевого инвестиционного фонда связано с отрицательным финансовым результатом по короткой позиции во фьючерсных контрактах, базовым активом которых является иностранная валюта (доллар США), из-за прироста официального курса доллара США: +42,84%. Оценочная стоимость еврооблигаций, составляющих активы паевого инвестиционного фонда, увеличилась меньше, чем курс доллара США, из-за негативной конъюнктуры на российском финансовом рынке:
Еврооблигация Kuznetski Capital S.A., ISIN: XS0299183250, дата погашения: 10.05.17, изменение: +22,70%;
Еврооблигация Sibur Securities Limited, ISIN: XS0878855773, дата погашения: 31.01.18, изменение: +29,63%.;
Еврооблигация RSHB Capital S.A., ISIN: XS0632887997, дата погашения: 03.06.21, изменение: +4,24%.;
Еврооблигация VTB CAPITAL S.A., ISIN: XS0842078536, дата погашения: 17.10.22, изменение: +5,77%.;
Еврооблигация SB CAPITAL S.A., ISIN: XS0935311240, дата погашения: 23.05.23, изменение: -10,73%.;
Еврооблигация GPB Eurobond Finance PLC, ISIN: XS1040726587, дата погашения: 05.09.19, изменение: +2,04%.;
Еврооблигация GPB Eurobond Finance PLC, ISIN: XS0975320879, дата погашения: 28.12.23, изменение: +7,39%.;

Еврооблигация GPB Eurobond Finance PLC, ISIN: XS0783291221, дата погашения: 17.05.17, изменение: +2,55%.;
Еврооблигация Novatek Finance Limited, ISIN: XS0864383723, дата погашения: 13.12.22, изменение: -8%.;
Еврооблигация RUSSIAN STANDARD FINANCE S.A, ISIN: XS0841677387, дата погашения: 10.04.2018,
изменение: -27,25%.

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 /