

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 30 сентября 2015 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 исправления таких ошибок:

В 3 квартале 2015 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 залогом:

На 30 сентября 2015 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-12.15 (фьючерсный контракт на курс доллар США – российский рубль) базовый актив - доллар США	500	1 000		33 118 350,00	иностранная валюта	Денеж. средства на депозит. счете (USD), Джей энд Ти Банк (АО)	500 000	33 118 350,00
ИТОГО:						33 118 350,00				33 118 350,00

4. Сведения о событиях, которые оказали существенное влияние на стоимость чистых активов паевого инвестиционного фонда:

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 инвестиционного фонда:

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 2015 года увеличилась оценочная стоимость еврооблигаций, составляющих активы паевого инвестиционного фонда:

Еврооблигация, Республика Казахстан, ISIN: XS1263054519, дата погашения: 21.07.2025, изменение: +12,89%;

Облигация, Government of the United States of America, ISIN: US912828VB32, дата погашения: 15.05.2023, изменение: +22,63%;

Еврооблигация, AK BARS LUXEMBOURG S.A., ISIN: XS0855334289, дата погашения: 19.11.2015, изменение: +18,70%;

Еврооблигация, Alfa Bond Issuance PLC, ISIN: XS0288690539, дата погашения: 22.02.2017, изменение: +12,73%;

Еврооблигация, Evraz Group S.A., ISIN: XS0359381331, дата погашения: 24.04.2018, изменение: +20,96%;

Еврооблигация, OFCB Capital PLC, ISIN: XS0503839622, дата погашения: 21.10.2015, изменение: +18,39%;

Еврооблигация, VPB Funding Limited, ISIN: XS0993279958, дата погашения: 14.11.2016, изменение: +19,47%.

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

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

Уполномоченное лицо
АО "Специализированный депозитарий "ИНФИНИТУМ" _____ / _____ /