

Справка
о стоимости активов на 30.09.2015

Открытый паевой инвестиционный фонд облигаций "Резервный. Валютные инвестиции" под управлением Общества с ограниченной ответственностью УК "Система Капитал"

Общество с ограниченной ответственностью УК "Система Капитал"

Лицензия ФКЦБ России № 21-000-1-00041 от 17 января 2001 г. Место нахождения УК: Российская Федерация, 119034, г. Москва, ул. Пречистенка, д. 17/9, тел. +7 (495) 228-15-05.

Правила доверительного управления паевым инвестиционным фондом № 2671 зарегистрированы 04.10.2013 Банком России

(в тыс. руб.)

Вид активов	Код стр.	Сумма денежных средств или стоимость иного имущества (тыс. рублей)	Доля от общей стоимости активов (процентов)	Доля от общего количества размещенных (выданных) ценных бумаг (долей) (процентов)
1	2	3	4	5
Денежные средства на банковских счетах, всего	100	20 125,54	0,45	x
в том числе:				
- в рублях	110	20 125,54	0,45	x
ПАО "МТС-БАНК"		20 125,54	0,45	x
- в иностранной валюте	120		-	x
Денежные средства в банковских вкладах, всего	200		-	x
в том числе:				
- в рублях	210		-	x
- в иностранной валюте	220		-	x
Ценные бумаги, имеющие признаваемую котировку, всего	300		-	x
в том числе:				
ценные бумаги российских эмитентов, включенные в котировальные списки организаторов торговли на рынке ценных бумаг:	310		-	x
включая				
- государственные ценные бумаги Российской Федерации	311		-	
- государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	312		-	
- муниципальные ценные бумаги	313		-	
- облигации российских хозяйственных обществ	314		-	x
- обыкновенные акции открытых акционерных обществ, за исключением акций акционерных инвестиционных фондов	315		-	
- обыкновенные акции акционерных инвестиционных фондов	316		-	
- привилегированные акции открытых акционерных обществ	317		-	x
- инвестиционные паи паевых инвестиционных фондов	318		-	
ценные бумаги российских эмитентов, не включенные в котировальные списки организаторов торговли на рынке ценных бумаг:	320		-	x
включая				
- государственные ценные бумаги Российской Федерации	321		-	
- государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	322		-	
- муниципальные ценные бумаги	323		-	
- облигации российских хозяйственных обществ	324		-	x
- обыкновенные акции открытых акционерных обществ, за исключением акций акционерных инвестиционных фондов	325		-	
- обыкновенные акции акционерных инвестиционных фондов	326		-	
- привилегированные акции открытых акционерных обществ	327		-	x
- обыкновенные акции закрытых акционерных обществ	328		-	
- инвестиционные паи паевых инвестиционных фондов	329		-	
Ценные бумаги иностранных эмитентов, не имеющие признаваемую котировку, всего	400		-	x
в том числе:				
- государственные ценные бумаги Российской Федерации	410		-	
- государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	420		-	
- муниципальные ценные бумаги	430		-	
- облигации российских хозяйственных обществ	440		-	x
- обыкновенные акции открытых акционерных обществ, за исключением акций акционерных инвестиционных фондов	450		-	
- обыкновенные акции акционерных инвестиционных фондов	460		-	
- привилегированные акции открытых акционерных обществ	470		-	x
- обыкновенные акции закрытых акционерных обществ	480		-	
- инвестиционные паи паевых инвестиционных фондов	490		-	
- векселя	491		-	x
Ценные бумаги иностранных эмитентов, всего	500	4 364 019,66	97,07	x
в том числе:				
- ценные бумаги иностранных государств	510		-	
- ценные бумаги международных финансовых организаций	520		-	
- облигации иностранных коммерческих организаций	530	4 364 019,66	97,07	

Облигация иностранной коммерческой организации, GBP Eurobond Finance PLC, XS0783291221, период выплат купона - полугодовой, дата погашения: 17.05.2017		273 403,24	6,08	0,4078
Облигация иностранной коммерческой организации, NORD GOLD N.V., XS0923472814, период выплат купона - полугодовой, дата погашения: 07.05.2018		166 732,68	3,71	0,5000
Облигация иностранной коммерческой организации, Sistema International Funding S.A., XS0783242877, период выплат купона - полугодовой, дата погашения: 17.05.2019		389 614,87	8,67	1,2000
Облигация иностранной коммерческой организации, VTB Capital, Societe Anonume, XS0772509484, период выплат купона - полугодовой, дата погашения: 12.04.2017		637 387,42	14,18	0,4700
Облигация иностранной коммерческой организации, DME Airport Limited, XS0995845566, период выплат купона - полугодовой, дата погашения: 26.11.2018		122 834,64	2,73	0,6667
Облигация иностранной коммерческой организации, Evraz Group S.A., XS0359381331, период выплат купона - полугодовой, дата погашения: 24.04.2018		338 412,28	7,53	0,9525
Облигация иностранной коммерческой организации, EuroChem Global Investments Limited, XS0863583281, период выплат купона - полугодовой, дата погашения: 12.12.2017		638 321,57	14,20	1,2900
Облигация иностранной коммерческой организации, MB Capital S.A., XS0246937162, период выплат купона - полугодовой, дата погашения: 10.03.2016		626 210,11	13,93	15,9967
Облигация иностранной коммерческой организации, Steel Funding Limited, XS0808632847, период выплат купона - полугодовой, дата погашения: 19.02.2018		484 330,29	10,77	1,0472
Облигация иностранной коммерческой организации, PSB Finance S.A., XS0775984213, период выплат купона - полугодовой, дата погашения: 25.04.2017		136 594,65	3,04	0,6806
Облигация иностранной коммерческой организации, Rosneft Finance, Societe Anonume (TNK-BP Finance S.A.), XS0484209159, период выплат купона - полугодовой, дата погашения: 02.02.2020		134 814,20	3,00	0,4000
Облигация иностранной коммерческой организации, SCF Capital Limited, XS0552679879, период выплат купона - полугодовой, дата погашения: 27.10.2017		258 680,81	5,75	0,5000
Облигация иностранной коммерческой организации, Metalinvest Finance Ltd, XS0918297382, период выплат купона - полугодовой, дата погашения: 17.04.2020		156 682,91	3,49	0,2500
- акции иностранных акционерных обществ	540		-	
Доли в уставных капиталах российских обществ с ограниченной ответственностью	600		-	
Недвижимое имущество	700		-	x
Имущественные права на недвижимое имущество	800		-	x
Строящиеся и реконструируемые объекты недвижимого имущества	900		-	x
Проектно-сметная документация	1000		-	x
Иные доходные вложения в материальные ценности	1100		-	x
Дебиторская задолженность	1200	111 736,95	2,49	x
в том числе:				
- средства, переданные профессиональным участникам рынка ценных бумаг	1210	26 501,51	0,59	x
- дебиторская задолженность по сделкам купли-продажи имущества	1220		-	x
- дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по банковским вкладам и ценным бумагам	1230	85 235,43	1,90	x
- прочая дебиторская задолженность	1240		-	x
Итого активов: (строки 100 + 200 + 300 + 400 + 500 + 600 + 700 + 800 + 900 + 1000 + 1100 + 1200)	1300	4 495 882,15	100,00	x

Примечание:

Вид активов	Дата погашения ЦБ/ Срок возврата вклада/ Срок платежа по векселю
Облигации иностранных коммерческих организаций	
GBP Eurobond Finance PLC, еврооблигации, ISIN XS0783291221, период выплат купона - полугодовой, биржи: Ирландская ФБ, Берлинская биржа.	17.05.2017
NORD GOLD N.V., еврооблигации, ISIN XS0923472814, период выплат купона - полугодовой, биржи: Ирландская ФБ.	07.05.2018
Sistema International Funding S.A., еврооблигации, ISIN XS0783242877, период выплат купона - полугодовой, биржи: Ирландская ФБ, ЗАО "Фондовая биржа ММББ".	17.05.2019
VTB Capital, Societe Anonume, еврооблигации, ISIN XS0772509484, период выплат купона - полугодовой, биржи: Ирландская ФБ, Берлинская биржа, ЗАО "Фондовая биржа ММББ".	12.04.2017
DME Airport Limited, еврооблигации, ISIN XS0995845566, период выплат купона - полугодовой, биржи: Ирландская ФБ.	26.11.2018
Evraz Group S.A., еврооблигации, ISIN XS0359381331, период выплат купона - полугодовой, биржи: Штутгартская ФБ, Берлинская биржа, Франкфуртская ФБ, Лондонская ФБ, ЗАО "Фондовая биржа ММББ".	24.04.2018
EuroChem Global Investments Limited, еврооблигации, ISIN XS0863583281, период выплат купона - полугодовой, биржи: Ирландская ФБ, ЗАО "Фондовая биржа ММББ".	12.12.2017
MB Capital S.A., еврооблигации, ISIN XS0246937162, период выплат купона - полугодовой, биржи: Люксембургская ФБ.	10.03.2016
Steel Funding Limited, еврооблигации, ISIN XS0808632847, период выплат купона - полугодовой, биржи: Люксембургская ФБ.	19.02.2018
PSB Finance S.A., еврооблигации, ISIN XS0775984213, период выплат купона - полугодовой, биржи: Берлинская биржа, Лондонская ФБ.	25.04.2017

<i>Rosneft Finance, Societe Anonyme (TNK-BP Finance S.A.), еврооблигации, ISIN XS0484209159, период выплат купона - полугодовой, биржи: Люксембургская ФБ.</i>	02.02.2020
<i>SCF Capital Limited, еврооблигации, ISIN XS0552679879, период выплат купона - полугодовой, биржи: Берлинская биржа, Лондонская ФБ.</i>	27.10.2017
<i>Metalloinvest Finance Ltd, еврооблигации, ISIN XS0918297382, период выплат купона - полугодовой, биржи: Ирландская ФБ.</i>	17.04.2020

Генеральный директор _____ Бусаров Игорь Геннадьевич

Руководитель бэк-офиса _____ Ворушила Марина Олеговна