

Пояснительная записка
к справке о стоимости чистых активов
Открытого паевого инвестиционного фонда облигаций «Резервный. Валютные
инвестиции»
под управлением Общества с ограниченной ответственностью
УК «Система Капитал»
за 3 квартал 2015 года

Правила доверительного управления Открытым паевым инвестиционным фондом облигаций «Резервный. Валютные инвестиции» под управлением Общества с ограниченной ответственностью УК «Система Капитал» были зарегистрированы Банком России 04.10.2013 г. за регистрационным номером в реестре ПИФ - 2671.

Стоимость чистых активов Открытого паевого инвестиционного фонда облигаций «Резервный. Валютные инвестиции» под управлением Общества с ограниченной ответственностью УК «Система Капитал» (далее – Фонд) рассчитывалась каждый рабочий день в соответствии с требованиями «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», утвержденного Приказом ФСФР от 15.06.2005 №05-21/пз-н.

Справка о стоимости чистых активов (далее - СЧА) Фонда и приложения к ней составлены на основании данных бухгалтерского и внутреннего учета управляющей компании и данных специализированного регистратора, в соответствии с Правилами определения стоимости активов и величины обязательств Фонда на 2015 год, утвержденными Генеральным директором и согласованными со специализированным депозитарием фонда 25 ноября 2014 года. Все данные справки о СЧА сверены и подтверждены специализированным депозитарием фонда.

В течение 3 квартала 2015 года ошибок, приведших к изменению стоимости инвестиционного пая на 0,5 и более процентов, не возникало.

Информация о забалансовых рисках Фонда отсутствует, обязательства и требования Фонда, не включенные в расчет СЧА, не возникали, опционы, форвардные и фьючерсные контракты с имуществом Фонда не заключались, в составе имущества Фонда отсутствуют активы, обремененные залогом.

За отчетный период изменений на 10 и более процентов признаваемых котировок ценных бумаг, составляющих активы паевого инвестиционного фонда, не было.

В состав активов Фонда в 3 квартале 2015 г. не входили акции, в связи с чем объявленные, но неполученные дивиденды отсутствуют.

Начисленных, но не полученных доходов по инвестиционным паям закрытых паевых инвестиционных фондов не зафиксировано в связи с их отсутствием в составе активов Фонда.

Сведения о прочих событиях, которые существенно повлияли на СЧА Фонда: за отчетный период произошло увеличение СЧА Фонда на 22,71 % в связи с ростом курса Доллара США.

Генеральный директор

Бусаров И.Г.

Руководитель бэк-офиса

Ворушилина М.О.

Уполномоченное лицо АО

«Специализированный депозитарий

«ИНФИНИТУМ»