

**Справка  
о стоимости активов на 31.12.2015**

**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	102 438,61	2,00	x
в том числе:				
- в рублях	110	11 423,95	0,22	x
ПАО "МТС-БАНК"		11 423,95	0,22	x
- в иностранной валюте	120	91 014,66	1,78	x
ПАО "МТС-БАНК"		91 014,66	1,78	x
Денежные средства в банковских вкладах, всего	200	816 286,24	15,94	x
в том числе:				
- в рублях	210		-	x
- в иностранной валюте	220	816 286,24	15,94	x
Депозит в ПАО Сбербанк, Договор № 018690482 от 24.12.2015 (срок возврата вклада: 12.01.2016)		816 286,24	15,94	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 российских 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	4 068 874,12	79,44	x
в том числе:				
- ценные бумаги иностранных государств	510		-	
- ценные бумаги международных финансовых организаций	520		-	
- облигации иностранных коммерческих организаций	530	4 068 874,12	79,44	

Облигация иностранной коммерческой организации, GBP Eurobond Finance PLC, XS0783291221, период выплат купона - полугодовой, дата погашения: 17.05.2017		302 223,73	5,90	0,4078
Облигация иностранной коммерческой организации, NORD GOLD N.V., XS0923472814, период выплат купона - полугодовой, дата погашения: 07.05.2018		184 059,79	3,59	0,5000
Облигация иностранной коммерческой организации, Alfa Bond Issuance PLC, XS0544362972, период выплат купона - полугодовой, дата погашения: 25.09.2017		382 878,33	7,48	0,5000
Облигация иностранной коммерческой организации, VTB Capital, Societe Anonume, XS0772509484, период выплат купона - полугодовой, дата погашения: 12.04.2017		372 080,76	7,26	0,2500
Облигация иностранной коммерческой организации, VIP Finance Ireland Limited, XS0361041808, период выплат купона - полугодовой, дата погашения: 30.04.2018		47 455,82	0,93	0,0600
Облигация иностранной коммерческой организации, EuroChem Global Investments Limited, XS0863583281, период выплат купона - полугодовой, дата погашения: 12.12.2017		623 089,87	12,17	1,1333
Облигация иностранной коммерческой организации, MB Capital S.A., XS0246937162, период выплат купона - полугодовой, дата погашения: 10.03.2016		610 216,60	11,91	14,1667
Облигация иностранной коммерческой организации, Steel Funding Limited, XS0808632847, период выплат купона - полугодовой, дата погашения: 19.02.2018		535 205,66	10,45	1,0472
Облигация иностранной коммерческой организации, PSB Finance S.A., XS0775984213, период выплат купона - полугодовой, дата погашения: 25.04.2017		315 434,43	6,16	1,4293
Облигация иностранной коммерческой организации, RSHB Capital, Societe Anonume, XS0366630902, период выплат купона - полугодовой, дата погашения: 29.05.2018		230 437,61	4,50	0,3061
Облигация иностранной коммерческой организации, SCF Capital Limited, XS0552679879, период выплат купона - полугодовой, дата погашения: 27.10.2017		289 971,11	5,66	0,5000
Облигация иностранной коммерческой организации, Metalloinvest Finance Ltd, XS0918297382, период выплат купона - полугодовой, дата погашения: 17.04.2020		175 820,40	3,43	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	134 275,23	2,62	x
в том числе:				
- средства, переданные профессиональным участникам рынка ценных бумаг	1210	81 183,98	1,59	x
- дебиторская задолженность по сделкам купли-продажи имущества	1220		-	x
- дебиторская задолженность по процентному (купонному) доходу по банковским вкладам и ценным бумагам	1230	53 091,26	1,04	x
- прочая дебиторская задолженность	1240		-	x
<b>Итого активов: (строки 100 + 200 + 300 + 400 + 500 + 600 + 700 + 800 + 900 + 1000 + 1100 + 1200)</b>	<b>1300</b>	<b>5 121 874,20</b>	<b>100,00</b>	<b>x</b>

Примечание:

Вид активов	Дата погашения ЦБ/ Срок возврата вклада/ Срок платежа по векселю
Денежные средства в банковских вкладах	
Депозит №018690482 в ПАО Сбербанк от 24.12.2015	12.01.2016
Облигации иностранных коммерческих организаций	
GBP Eurobond Finance PLC, еврооблигации, ISIN XS0783291221, период выплат купона - полугодовой, биржи: Ирландская ФБ.	17.05.2017
NORD GOLD N.V., еврооблигации, ISIN XS0923472814, период выплат купона - полугодовой, биржи: Ирландская ФБ.	07.05.2018
Alfa Bond Issuance Public Limited Company, еврооблигации, ISIN XS0544362972, период выплат купона - полугодовой, биржи: Лондонская ФБ, ЗАО "Фондовая биржа ММББ".	25.09.2017
VTB Capital, Societe Anonume, еврооблигации, ISIN XS0772509484, период выплат купона - полугодовой, биржи: Ирландская ФБ, ЗАО "Фондовая биржа ММББ".	12.04.2017
VIP Finance Ireland Limited, еврооблигации, ISIN XS0361041808, период выплат купона - полугодовой, биржи: Ирландская ФБ.	30.04.2018
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: Ирландская ФБ.	19.02.2018
PSB Finance S.A., еврооблигации, ISIN XS0775984213, период выплат купона - полугодовой, биржи: Лондонская ФБ.	25.04.2017
RSHB Capital, Societe Anonume, еврооблигации, ISIN XS0366630902, период выплат купона - полугодовой, биржи: Ирландская ФБ.	29.05.2018
SCF Capital Limited, еврооблигации, ISIN XS0552679879, период выплат купона - полугодовой, биржи: Лондонская ФБ.	27.10.2017
Metalloinvest Finance Ltd, еврооблигации, ISIN XS0918297382, период выплат купона - полугодовой, биржи: Ирландская ФБ.	17.04.2020

Генеральный директор

Бусаров Игорь Геннадьевич

Руководитель бэк-офиса

\_\_\_\_\_ Ворушила Марина Олеговна