

РАСЧЕТ СОБСТВЕННЫХ СРЕДСТВ УПРАВЛЯЮЩЕЙ КОМПАНИИ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ, ПАЕВЫХ
ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ И НЕГОСУДАРСТВЕННЫХ ПЕНСИОННЫХ ФОНДОВ

Раздел I. Реквизиты управляющей компании

Полное наименование управляющей компании	Номер лицензии управляющей компании
1	2
Общество с ограниченной ответственностью "Управляющая компания "Альфа-Капитал"	21-000-1-00028

Раздел II. Параметры расчета собственных средств

Текущая отчетная дата	Предыдущая отчетная дата
1	2
31.03.2018	28.02.2018

Раздел III. Расчет собственных средств

в рублях

Наименование показателя	Код строки	Сумма (стоимость, величина) на текущую отчетную дату	Сумма (стоимость, величина) на предыдущую отчетную дату
1	2	3	4
Подраздел «Активы, принятые к расчету собственных средств»			
Денежные средства – всего	01	151 804 926.33	92 829 085.36
в том числе:			
на счетах в кредитных организациях	01.01	151 804 926.33	92 829 085.36
на счетах по депозиту в кредитных организациях	01.02	0.00	0.00
Ценные бумаги – всего	02	1 443 606 695.86	1 440 136 381.13
в том числе:			
облигации – всего	02.01	1 443 606 695.86	1 440 136 381.13
в том числе:			
облигации российских хозяйственных обществ	02.01.01	361 574 183.50	361 110 371.00
государственные ценные бумаги Российской Федерации	02.01.02	15 202 858.23	15 271 200.53
государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации	02.01.03	0.00	0.00
муниципальные ценные бумаги	02.01.04	0.00	0.00
облигации иностранных коммерческих организаций	02.01.05	1 066 829 654.13	1 063 754 809.60
облигации иностранных государств	02.01.06	0.00	0.00
облигации международных финансовых организаций	02.01.07	0.00	0.00
акции – всего	02.02	0.00	0.00
в том числе:			
российских акционерных обществ	02.02.01	0.00	0.00
иностранных акционерных обществ	02.02.02	0.00	0.00
Недвижимое имущество	03	0.00	0.00
Дебиторская задолженность	04	26 087 191.55	2 328 684.90
Общая стоимость активов (сумма строк 01 + 02 + 03 + 04)	05	1 621 498 813.74	1 535 294 151.39
Подраздел «Обязательства»			
Общая величина обязательств	06	450 218 125.64	162 022 574.55
Подраздел «Размер собственных средств»			
Размер собственных средств (разность строк 05 - 06)	07	1 171 280 688.10	1 373 271 576.84
Минимальный размер собственных средств			
Минимальный размер собственных средств	08	67 914 325.15	65 575 206.19
Указание на соответствие размера собственных средств управляющей компании требованиям к минимальному размеру собственных средств (соответствует/ не соответствует)	СООТВЕТСТВУЕТ		

Расшифровки строк подраздела «Активы, принятые к расчету собственных средств»

01.01. Денежные средства на счетах в кредитных организациях

Номер строки	Наименование кредитной организации, с которой заключен договор (договоры) банковского счета	ОГРН кредитной организации	Регистрационный номер кредитной организации	Порядковый номер филиала кредитной организации	Код валюты счета	Вид банковского счета (расчетный, другие счета)	Сумма денежных средств, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Рейтинг долгосрочной кредитоспособности кредитной организации, а также указание на то, кем он присвоен	Кредитная организация является аффилированным лицом управляющей компании (да (нет))
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
1	АО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	1326	би	RUB (Российский рубль)	Расчетный счет	45 545.43	0.00	АКРА AA(RU)	Нет
2	АО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	1326	би	RUB (Российский рубль)	Расчетный счет	449 127.68	0.03	АКРА AA(RU)	Нет
3	АО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	1326	би	RUB (Российский рубль)	Расчетный счет	151 191 550.93	9.32	АКРА AA(RU)	Нет
4	АО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	1326	би	USD (Доллар США)	Расчетный счет	0.00	0.00	АКРА AA(RU)	Нет
5	ПАО "СБЕРБАНК"	1027700132195	1481	01869	RUB (Российский рубль)	Расчетный счет	118 702.29	0.01	АКРА AAA(RU)	Нет
Итого	X	X	X	X	X	X	151 804 926.33	9.36	X	X

01.02. Денежные средства на счетах по депозиту в кредитных организациях

Номер строки	Наименование кредитной организации, в которой открыт счет по депозиту	ОГРН кредитной организации	Регистрационный номер кредитной организации	Порядковый номер филиала кредитной организации	Код валюты счета по депозиту	Дата возврата денежных средств	Сумма денежных средств, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Рейтинг долгосрочной кредитоспособности кредитной организации, а также указание на то, кем он присвоен	Кредитная организация является аффилированным лицом управляющей компании (да (нет))
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
Итого	X	X	X	X	X	X	0.00	0.00	X	X

02.01.01. Облигации российских хозяйственных обществ

Номер строки	Наименование эмитента	ОГРН эмитента	ИНН эмитента	Организационно-правовая форма эмитента	Государственный регистрационный номер (идентификационный номер) выпуска	Код ISIN (если присвоен)	Дата погашения	Количество в составе активов, штук	Стоимость актива, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Рейтинг долгосрочной кредитоспособности выпуска (эмитента, поручителя (гаранта), а также указание на то, кем он присвоен	Эмитент является аффилированным лицом управляющей компании (да (нет))
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
1	ПАО "Транснефть"	1027700049486	7706061801	ПУБЛИЧНОЕ АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО	4B02-06-00206-A-001P	RU000A0JXM97	24.03.2021	47 000.00	49 563 380.00	3.06	ЭКСПЕРТ РА ruAAA	Нет
2	ПАО "НК "Роснефть"	1027700043502	7706107510	ПУБЛИЧНОЕ АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО	4B02-04-00122-A-001P	RU000A0JXQK2	22.04.2027	100 850.00	110 280 483.50	6.80	ЭКСПЕРТ РА ruAAA	Нет
3	ПАО "НК "Роснефть"	1027700043502	7706107510	ПУБЛИЧНОЕ АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО	4B02-04-00122-A-002P	RU000A0ZYU40	03.02.2028	198 000.00	201 730 320.00	12.44	ЭКСПЕРТ РА ruAAA	Нет
Итого	X	X	X	X	X	X	X	X	361 574 183.50	22.30	X	X

02.01.02. Государственные ценные бумаги Российской Федерации

Номер строки	Наименование эмитента	ОГРН эмитента	ИНН эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска	Код ISIN (если присвоен)	Дата погашения	Количество в составе активов, штук	Стоимость актива, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Рейтинг долгосрочной кредитоспособности выпуска (эмитента, поручителя (гаранта), а также указание на то, кем он присвоен	Эмитент является аффилированным лицом управляющей компании (да (нет)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
1	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	7710168360	26217RMFS	RU000A0JW30	18.08.2021	5 617.00	5 851 678.26	0.36	BBB- Fitch	Нет
2	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	7710168360	29006RMFS	RU000A0JV4L2	29.01.2025	4 479.00	4 901 951.97	0.30	AKPA AAA(RU)	Нет
3	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	7710168360	26219RMFS	RU000A0JWM07	16.09.2026	4 200.00	4 449 228.00	0.27	AKPA AAA(RU)	Нет
Итого	X	X	X	X	X	X	X	15 202 858.23	0.93	X	X

02.01.03. Государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации

Номер строки	Наименование эмитента	Наименование субъекта Российской Федерации, от имени которого выпущены ценные бумаги	ОГРН эмитента	ИНН эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска	Код ISIN (если присвоен)	Дата погашения	Количество в составе активов, штук	Стоимость актива, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Рейтинг долгосрочной кредитоспособности выпуска (эмитента, поручителя (гаранта), а также указание на то, кем он присвоен	Эмитент является аффилированным лицом управляющей компании (да (нет)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Итого	X	X	X	X	X	X	X	X	0.00	0.00	X	X

02.01.04. Муниципальные ценные бумаги

Номер строки	Наименование эмитента	Наименование муниципального образования, от имени которого выпущены ценные бумаги, согласно уставу муниципального образования	ОГРН эмитента	ИНН эмитента	Государственный регистрационный номер выпуска	Код ISIN (если присвоен)	Дата погашения	Количество в составе активов, штук	Стоимость актива, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Рейтинг долгосрочной кредитоспособности выпуска (эмитента, поручителя (гаранта), а также указание на то, кем он присвоен	Эмитент является аффилированным лицом управляющей компании (да (нет)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Итого	X	X	X	X	X	X	X	X	0.00	0.00	X	X

02.01.05. Облигации иностранных коммерческих организаций

Номер строки	Наименование эмитента	Код государства регистрации (инкорпорации) эмитента	TIN эмитента	Регистрационный номер выпуска	Код ISIN (если имеется)	Код валюты	Дата погашения	Количество в составе активов, штук	Стоимость актива, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Рейтинг долгосрочной кредитоспособности выпуска (эмитента, поручителя (гаранта), а также указание на то, кем он присвоен	Эмитент является аффилированным лицом управляющей компании (да (нет)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
1	Alfa Bond Issuance PLC	IRL (Ирландия)	410510	XS0832412505	US01538RAC34	USD (Доллар США)	26.09.2019	10 934.00	650 968 779.55	40.15	Ba3 Moody's	Нет
2	Alfa Bond Issuance PLC	IRL (Ирландия)	410510	XS1135611652	US01538RAE99	USD (Доллар США)	18.02.2025	4 601.00	282 828 978.36	17.44	B1 Moody's	Нет
3	SB CAPITAL S.A.	LUX (Люксембург)	B115914	XS0848530977	US78406JAC80	USD (Доллар США)	29.10.2022	1 123.00	66 589 924.34	4.11	Ba2 Moody's	Нет
4	SB CAPITAL S.A.	LUX (Люксембург)	B115914	XS1032750165	US78406JAE47	USD (Доллар США)	26.02.2024	1 145.00	66 441 971.88	4.10	BB+ Fitch	Нет
Итого	X	X	X	X	X	X	X	X	1 066 829 654.13	65.80	X	X

02.01.06. Облигации иностранных государств

Номер строки	Наименование эмитента	Код государства регистрации (инкорпорации) эмитента	TIN эмитента	Регистрационный номер выпуска	Код ISIN (если присвоен)	Код валюты	Дата погашения	Количество в составе активов, штук	Стоимость актива, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Рейтинг долгосрочной кредитоспособности выпуска (эмитента, поручителя (гаранта), а также указание на то, кем он присвоен	Эмитент является аффилированным лицом управляющей компании и (да (нет)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Итого	X	X	X	X	X	X	X	X	0.00	0.00	X	X

02.01.07. Облигации международных финансовых организаций

Номер строки	Наименование эмитента	TIN эмитента	Регистрационный номер выпуска	Код ISIN (если присвоен)	Код валюты	Дата погашения	Количество в составе активов, штук	Стоимость актива, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Рейтинг долгосрочной кредитоспособности выпуска (эмитента, поручителя (гаранта), а также указание на то, кем он присвоен	Эмитент является аффилированным лицом управляющей компании и (да (нет)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
Итого	X	X	X	X	X	X	X	0.00	0.00	X	X

02.02.01. Акции российских акционерных обществ

Номер строки	Наименование эмитента	ОГРН эмитента	ИНН эмитента	Организационно-правовая форма эмитента	Государственный регистрационный номер (идентификационный номер) выпуска	Код ISIN (если присвоен)	Категория (тип) акций	Количество в составе активов, штук	Стоимость актива, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Наименование российской биржи, в котировальном списке первого (высшего) уровня которой включены акции	Эмитент является аффилированным лицом управляющей компании и (да (нет)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Итого	X	X	X	X	X	X	X	X	0.00	0.00	X	X

02.02.02. Акции иностранных акционерных обществ

Номер строки	Наименование эмитента	Код государства регистрации (инкорпорации) эмитента	TIN эмитента	Регистрационный номер выпуска	Код ISIN (если присвоен)	Код валюты	Количество в составе активов, штук	Стоимость актива, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Наименование российской биржи, в котировальном списке первого (высшего) уровня которой включены акции	Эмитент является аффилированным лицом управляющей компании и (да (нет)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
Итого	X	X	X	X	X	X	X	0.00	0.00	X	X

03. Недвижимое имущество

Номер строки	Кадастровый (условный) номер объекта или указание на то, что кадастровый (условный) номер не присвоен	Вид объекта	Назначение объекта недвижимого имущества (для земельных участков – категория земель и вид разрешенного использования)	Код государства, на территории которого располагается объект недвижимости	Адрес (местоположение) объекта	Общая стоимость актива, в рублях	Стоимость актива, принятая к расчету собственных средств, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Полное наименование организации, с которой заключен договор об оценке	ИНН организации, с которой заключен договор об оценке	Фамилия, имя, отчество (при наличии) оценщика, составившего отчет об оценке	Полное наименование организации, составившей положительное экспертное заключение на отчет об оценке
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Итого	X	X	X	X	X	0.00	0.00	0.00	X	X	X	X

04. Дебиторская задолженность.

Номер строки	Вид (описание) задолженности	Основание возникновения задолженности	Дата окончания срока погашения задолженности	Наименование должника	Место нахождения должника	ОГРН (ТIN) должника по договору	Сумма задолженности, в рублях	Доля от общей стоимости активов, принятых к расчету собственных средств, в процентах	Рейтинг долгосрочной кредитоспособности должника, а также указание на то, кем он присвоен	Должник является аффилированным лицом управляющей компании (да (нет))
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
1	Брокерский счет	Брокерский счет	01.01.1999	АО "АЛЬФА-БАНК"	107078, г. Москва, ул. Каланчевская, д. 27	1027700067328	26 087 191.55	1.61	АКРА AA(RU)	Нет
Итого	X	X	X	X	X	X	26 087 191.55	1.61	X	X

Расшифровки строки 06 подраздела «Обязательства»

06.01. Кредиторская задолженность (кредитор – физическое лицо)

Номер строки	Вид (описание) задолженности	Основание возникновения задолженности	Дата окончания срока погашения задолженности	Фамилия, имя, отчество (при наличии последнего) кредитора	Сведения о документе, удостоверяющем личность кредитора	Сумма задолженности, в рублях	Доля от общей величины обязательств, в процентах
1	2	3	4	5	6	7	8
1	резерв предстоящих расходов на выплату отпускных	Трудовой договор	01.01.1999	Сотрудники компании	XXXXXXXXXX	86 334 779.32	19.18
2	резерв на выплату премий	Трудовой договор	01.01.1999	Сотрудники компании	XXXXXXXXXX	4 122 589.55	0.92
Итого	X	X	X	X	X	90 457 368.87	20.10

06.02. Кредиторская задолженность (кредитор – юридическое лицо)

Номер строки	Вид (описание) задолженности	Основание возникновения задолженности	Дата окончания срока погашения задолженности	Наименование кредитора	Место нахождения кредитора	ОГРН (ТIN) кредитора по договору	Сумма задолженности, в рублях	Доля от общей величины обязательств, в процентах
1	2	3	4	5	6	7	8	9
1	Агентское вознаграждение	Акт би от 31.03.2018	13.04.2018	АО "АЛЬФА-БАНК"	107078, Москва, ул. Каланчевская, д. 27	1027700067328	36 776 507.39	8.17
2	Услуги по привлечению клиентов в ДУ	Акт би от 31.03.2018	18.04.2018	АО "АЛЬФА-БАНК"	107078, Москва, ул. Каланчевская, д. 27	1027700067328	178 805 525.61	39.72
3	Информационные и консультационные услуги, направленные на поиск и привлечение клиентов с целью заключения договоров ДУ.	Акт би от 31.03.2018	19.04.2018	АО "АЛЬФА-БАНК"	107078, Москва, ул. Каланчевская, д. 27	1027700067328	62 350 822.28	13.85
4	НДФЛ	Трудовой договор	06.04.2018	Инспекция Федеральной налоговой службы № 3 по г.Москве	123100, г. Москва, ул. Анатолия Живова, д. 2, стр. 6	1047703058435	5 927 594.00	1.32
5	Страховые взносы на ОПС, ОМС, ОСС	Трудовой договор	15.04.2018	Инспекция Федеральной налоговой службы № 3 по г.Москве	123100, г. Москва, ул. Анатолия Живова, д. 2, стр. 6	1047703058435	12 703 433.95	2.82
6	Создание аудиовизуальных произведений	Акт от 16.03.2018	23.03.2018	ЗАКРЫТОЕ АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "БЬЮ БРЕНДИНГ КОНСУЛЬТАНТЫ"	125147, город Москва, Тверская-Ямская 1-я улица, 16/23 стр.2	1067760494999	5 941 806.84	1.32
7	Размещение рекламно-информационных материалов в сети Интернет	Акт от 31.03.2018	25.04.2018	«ОПТИМУМ МЕДИА ЛИМИТЕД»	107031, г. Москва, ул. Рождественка, д. 19	0000000000000	9 196 717.01	2.04
Итого	X	X	X	X	X	X	311 702 407.08	69.24

06.03. Иные обязательства

Номер строки	Вид (описание) обязательства	Основание возникновения обязательства	Размер обязательства, в рублях	Доля от общей величины обязательств, в процентах
1	2	3	4	5
Итого	X	X	0.00	0.00