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

Раздел І. 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
l	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)	COOTBETCTBYET		

01.01. Денежные средства на счетах в кредитных организациях

		OFFITE N	n		Tro	n c			n v	**
Номер строки	Наименование кредитной			Порядковый номер филиала кредитной	Код валюты счета	Вид банковского	Сумма денежных	Доля от	Рейтинг	Кредитна
	организации, с которой			организации		счета (расчетный,	средств, в рублях	общей	долгосрочной	Я
	заключен договор		кредитной			другие счета)		стоимости	кредитоспособн	
	(договоры) банковского		организации					активов,	ости кредитной	ия
	счета							принятых к	организации, а	является
								расчету	также указание	аффилиро
								собственных	на то, кем он	ванным
								средств, в	присвоен	лицом
								процентах		управляю
								-		щей
										компании
										(да (нет)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
1	АО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	1326	бн	RUB (Российский рубль)	Расчетный счет	45 545.43	0.00	AKPA AA(RU)	Нет
2	АО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	1326	бн	RUB (Российский рубль)	Расчетный счет	449 127.68	0.03	AKPA AA(RU)	Нет
Ĩ	TO TELEVISION OF THE PARTY OF T	1027700007320	1320		res (rocenneum pyona)	r de lerman e ler	117 127.00	0.03	, and , r. r. a (RCO)	1101
3	АО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	1326	бн	RUB (Российский рубль)	Расчетный счет	151 191 550.93	9.32	AKPA AA(RU)	Нет
4	АО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	1326	бн	USD (Доллар США)	Расчетный счет	0.00	0.00	AKPA AA(RU)	Нет
e e	ПАО "СБЕРБАНК"	1027700132195	1481	01869	RUB (Российский рубль)	Расчетный счет	118 702.29	0.01	AKPA	Нет
,	IIAO CBEFBARK	1027700132193	1401	01809	ков (госсинский руоль)	гасчетный счет	110 /02.29	0.01	AAA(RU)	rici
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	ОГРН кредитной организации	Регистрацион	Порядковый номер филиала кредитной	Код валюты счета по депозиту	Дата возврата	Сумма денежных	Доля от	Рейтинг	Кредитна
	организации, в которой	*	ный номер	организации		денежных средств	средств, в рублях	общей	долгосрочной	я
	открыт счет по депозиту		кредитной			-		стоимости	кредитоспособн	организац
			организации					активов,	ости кредитной	ия
								принятых к	организации, а	
								расчету	также указание	аффилиро
								собственных	на то, кем он	ванным
								средств, в	присвоен	лицом
								процентах		управляю
										щей
										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

				т								
Номер	Наименование эмитента	ОГРН эмитента	ИНН эмитента	Организационно-	Государственный	Код ISIN (если	Дата погашения	Количество в	Стоимость актива, в	Доля от	Рейтинг	Эмитент
строки				правовая форма	регистрационный номер	присвоен)		составе активов,	рублях	общей	долгосрочной	
				эмитента	(идентификационный			штук		стоимос	кредитоспосо	аффили
					номер) выпуска					ти	бности	рованны
												м лицом
										приняты	(эмитента,	управля
										хк	поручителя	ющей
										расчету	(гаранта), а	компани
										собствен	также	и (да
										ных	указание на	(нет)
										средств,	то, кем он	
										В	присвоен	
										процент		
										ax		
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
—												\vdash
				ПУБЛИЧНОЕ								
				АКЦИОНЕРНОЕ							ЭКСПЕРТ РА	
1	ПАО "Транснефть"	1027700049486	7706061801	ОБЩЕСТВО	4B02-06-00206-A-001P	RU000A0JXM97	24.03.2021	47 000.00	49 563 380.00	3.06	ruAAA	Нет
				ПУБЛИЧНОЕ								
				АКЦИОНЕРНОЕ							ЭКСПЕРТ РА	
2	ПАО "НК "Роснефть"	1027700043502	7706107510	ОБЩЕСТВО	4B02-04-00122-A-001P	RU000A0JXQK2	22.04.2027	100 850.00	110 280 483.50	6.80	ruAAA	Нет
											1	
				ПУБЛИЧНОЕ							l	
L				АКЦИОНЕРНОЕ							ЭКСПЕРТ РА	
3	ПАО "НК "Роснефть"	1027700043502	7706107510	ОБЩЕСТВО	4B02-04-00122-A-002P	RU000A0ZYT40	03.02.2028	198 000.00	201 730 320.00	12.44	ruAAA	Нет
L				1							1	L
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

	1	OFFI			re remain	I.,	1.,			n v	n .
Номер	Наименование эмитента	ОГРН эмитента	ИНН эмитента			Дата погашения	Количество в	Стоимость актива,	Доля от	Рейтинг	Эмитент
строки				регистрационный номер			составе активов,	в рублях	общей		является
				выпуска			штук		стоимости	кредитоспособ	
									активов,	ности выпуска	ованным
									принятых к	(эмитента,	лицом
									расчету	поручителя	управля
									собственны	(гаранта), а	ющей
									х средств, в	также	компани
									процентах	указание на то,	и (да
											(нет)
										присвоен	/
										p	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
	Министерство финансов										
1	Российской Федерации	1037739085636	7710168360	26217RMFS	RU000A0JVW30	18.08.2021	5 617.00	5 851 678.26	0.36	BBB- Fitch	Нет
	Министерство финансов									AKPA	
2	Российской Федерации	1037739085636	7710168360	29006RMFS	RU000A0JV4L2	29.01.2025	4 479.00	4 901 951.97	0.30	AAA(RU)	Нет
	Министерство финансов									AKPA	
,		1037739085636	7710168360	26219RMFS	RU000A0JWM07	16.09.2026	4 200.00	4 449 228.00	0.27		Нет
3	Российской Федерации	103//39083636	//10108300	20219KMF5	KUUUUAUJ WMU /	10.09.2020	4 200.00	4 449 228.00	0.27	AAA(KU)	пет
1										1	
1										1	
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	Наименование эмитента	Наименование	ОГРН эмитента	ИНН эмитента	Государственный	Код ISIN (если	Дата погашения	Количество в	Стоимость актива, в	Доля от	Рейтинг	Эмитент
строки		субъекта			регистрационный номер	присвоен)		составе активов,	рублях	общей	долгосрочной	является
		Российской			выпуска			штук		стоимос	кредитоспосо	аффили
		Федерации, от								ти	бности	рованны
		имени которого								активов,	выпуска	м лицом
		выпущены ценные									(эмитента,	управля
		бумаги									поручителя	ющей
											(гаранта), а	компани
										собствен		и (да
										ных		(нет)
											то, кем он	
											присвоен	
										процент		
										ax		
	_	_			_		_	_				
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	Наименование эмитента	Наименование	ОГРН эмитента	ИНН эмитента	Государственный	Код ISIN (если	Дата погашения	Количество в	Стоимость актива, в	Доля от	Рейтинг	Эмитент
строки		муниципального			регистрационный номер	присвоен)		составе активов,	рублях	общей	долгосрочной	является
		образования, от			выпуска			штук		стоимос	кредитоспосо	аффили
		имени которого								ти	бности	рованны
		выпущены ценные								активов,	выпуска	м лицом
		бумаги, согласно								приняты	(эмитента,	управля
		уставу									поручителя	ющей
		муниципального									(гаранта), а	компани
		образования								собствен		и (да
											указание на	(нет)
											то, кем он	
											присвоен	
										процент		
										ax		
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	Наименование эмитента	Код государства	TIN эмитента	Регистрационный	Код ISIN (если имеется)	Код валюты	Дата погашения	Количество в	Стоимость актива, в	Доля от	Рейтинг	Эмитент
строки	Паименование эмитента	регистрации	Thy sanitchia	номер выпуска	код ізпу (сели иместем)	код валоты	дата погашения	составе активов,	рублях	общей	долгосрочной	
Строки		(инкорпорации)		помер выпуска				штук	руслих		кредитоспосо	
		эмитента						,			бности	рованны
										активов,	выпуска	м лицом
										приняты	(эмитента,	управля
										хк	поручителя	ющей
										расчету	(гаранта), а	компани
										собствен	также	и (да
										ных	указание на	(нет)
										средств,	то, кем он	
											присвоен	
										хк		
										расчету		
										собствен		
										ных		
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
1	Alfa Bond Issuance PLC	IRL (Ирдандия)	410510	XS0832412505	US01538RAC34	USD (Доллар	26.09.2019	10 934.00	650 968 779.55	40.15	Ba3 Moody's	Нет
						США)				40.15		
2	Alfa Bond Issuance PLC	IRL (Ирдандия)	410510	XS1135611652	US01538RAE99	USD (Доллар	18.02.2025	4 601.00	282 828 978.36		B1 Moody's	Нет
		(] //				США)				17.44	,	
3	SB CAPITAL S.A.	LUX	B115914	XS0848530977	US78406JAC80	USD (Доллар	29.10.2022	1 123.00	66 589 924.34	4.11	Ba2 Moody's	Нет
		(Люксембург)				CIIIA)						
4	SB CAPITAL S.A.	LUX	B115914	XS1032750165	US78406JAE47	USD (Доллар	26.02.2024	1 145.00	66 441 971.88	4.10	BB+ Fitch	Нет
ľ	DD CHI III III DILL	(Люксембург)	D113714	101032730103	CD7040071LT47	США)	20.02.2027	11-13.00	00 111 771.00	4.10	DD · T acii	1101
		(
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	Наименование эмитента	Код государства	TIN эмитента	Регистрационный	Код ISIN (если присвоен)	Код валюты	Дата погашения	Количество в	Стоимость актива, в	Доля от	Рейтинг	Эмитент
строки		регистрации		номер выпуска				составе активов,	рублях	общей	долгосрочной	является
		(инкорпорации)						штук			кредитоспосо	аффили
		эмитента								ти	бности	рованны
										активов,	выпуска	м лицом
										приняты	(эмитента,	управля
										хк	поручителя	ющей
										расчету		компани
										собствен		и (да
										ных	указание на	(нет)
											то, кем он	i l
										В	присвоен	i l
										процент		i l
										ax		i l
												i l
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Итого	Х	X	X	Х	X	Х	X	X	0.00	0.00	X	Х

02.01.07. Облигации международных финансовых организаций

Номер	Наименование эмитента	TIN эмитента	Регистрационный	Код ISIN (если	Код валюты	Дата погашения	Количество в	Стоимость актива,	Доля от	Рейтинг	Эмитент
строки			номер выпуска	присвоен)			составе активов,	в рублях	общей	долгосрочной	является
							штук		стоимости	кредитоспособ	аффилир
									активов,	ности выпуска	ованным
									принятых к		лицом
									расчетусобс		управля
										(гаранта), а	ющей
											компани
									процентах	указание на то,	
										кем он	(нет)
										присвоен	
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	Наименование эмитента	ОГРН эмитента	ИНН эмитента	Организационно-	Государственный	Код ISIN (если	Категория (тип)	Количество в	Стоимость актива, в	Hong on	Uaurananann	2 company
	паименование эмитента	ОГРИ эмитента			регистрационный номер						е российской	
строки						присвоен)						
					(идентификационный			штук				аффили
					номер) выпуска						котировальны	
										активов,		м лицом
										приняты		управля
										хк	(высшего)	ющей
										расчету	уровня	компани
										собствен	которой	и (да
										ных	включены	(нет)
										средств,	акции	
										В		
										процент		
										ax		
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	Наименование эмитента	Код государства	TIN эмитента	Регистрационный номер	Код ISIN (если присвоен)	Код валюты	Количество в	Стоимость актива,	Доля от	Наименование	Эмитент
строки		регистрации		выпуска			составе активов,	в рублях	общей	российской	является
		(инкорпорации)					штук		стоимости	биржи, в	аффилир
		эмитента							активов,	котировальны	ованным
									принятых к	й список	лицом
									расчету		управля
									собственны	(высшего)	ющей
									х средств, в		компани
									процентах		и (да
										включены	(нет)
										акции	
1	2	2	4			7	0	0	10	1.1	12
1	2	3	4	3	6	/	٥	9	10	11	12
Итого	X	X	X	X	X	X	X	0.00	0.00	X	X

03. Недвижимое имущество

						1	1.					
Номер		Вид объекта	Назначение	Код государства, на	, 4 · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	Общая стоимость	Стоимость	Доля от общей	Полное	ИНН	Фамилия,	Полное
строки	номер объекта или		объекта	территории которого	объекта	актива, в рублях	актива, принятая	стоимости	наименование	организа	имя, отчество	наимено
	указание на то, что		недвижимого	располагается объект			к расчету	активов,	организации, с	ции, с	(при наличии	вание
	кадастровый (условный)		имущества (для	недвижимости			собственных	принятых к	которой заключен	которой	последнего)	организ
	номер не присвоен		земельных				средств, в рублях	расчету	договор об оценке	заключе	оценщика,	ации,
			участков -					собственных		Н	составившего	составив
			категория земель и					средств, в		договор	отчет об	шей
			вид разрешенного					процентах		об	оценке	положит
			использования)							оценке		ельное
												эксперт
												ное
												заключе
												ние на
												отчет об
												оценке
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
											l	
								1		1	ĺ	
Итого	X	X	X	X	X	0.00	0.00	0.00	X	X	X	X

04. Дебиторская задолженность

Номер строки	Вид (описание)	Основание возникновения	Дата	Наименование должника	Место нахождения должника	OFPH (TIN)	Сумма	Доля от	Рейтинг	Должник
	задолженности	задолженности	окончания			должника по	задолженности, в	общей	долгосрочной	является
			срока			договору	рублях	стоимости	кредитоспособн	аффилиро
			погашения					активов,	ости должника,	ванным
			задолженност					принятых к	а также	лицом
			И					расчету		управляю
								собственных		щей
									присвоен	компании
								процентах		(да (нет)
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
1	Брокерский счет	Брокерский счет	01.01.1999		107078, г. Москва, ул. Каланчевская, д. 27	1027700067328	26 087 191.55	1.61	AKPA AA(RU)	Нет
Итого	х	x	х	х	x	х	26 087 191.55	1.61	х	Х

Расшифровки строки 06 подраздела «Обязательства»

06.01. Кредиторская задолженность (кредитор – физическое лицо)

Номер строки	,,,,			кредитора	удостоверяющем личность	* *	Доля от общей величины обязательств, в процентах
1	2 резерв предстоящих расходов на выплату отпускных	З Трудовой договор	4 01.01.1999	5 Сотрудники компании	6 XXXXXXXXX	86 334 779.32	19.18
2	резерв на выплату премий	Трудовой договор	01.01.1999	Сотрудники компании	XXXXXXXX	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 (TIN) кредитора по договору	Сумма задолженности, в рублях	Доля от общей величины обязательств, в процентах
	2	3	4	5	6	7	8	9
	Агентское вознаграждение	Акт бн от 31.03.2018	13.04.2018	АО "АЛЬФА-БАНК"	107078, Москва, ул. Каланчевская, д. 27	1027700067328	36 776 507.39	8.17
	Услуги по привлечению клиентов в Д.У.	Акт бн от 31.03.2018	18.04.2018	АО "АЛЬФА-БАНК"	107078, Москва, ул. Каланчевская, д. 27	1027700067328	178 805 525.61	39.72
	Информационные и консультационные услуги, направленные на поиск и привлечение клиентов с целью заключения договоров Д.У.	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
	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
	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
	Создание аудиовизуальных произведений	Акт от 16.03.2018	23.03.2018	ЗАКРЫТОЕ АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО "ББДО БРЕНДИНІ КОНСУЛЬТАНТЫ"	125147, город Москва, Тверская- Ямская 1-я улица, 16/23 стр.2	1067760494999	5 941 806.84	1.32
	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	000000000000	9 196 717.01	2.04
того	x	х	X	х	х	X	311 702 407.08	69.24

06.03. Иные обязательства

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