

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

Расчет собственных средств управляющей компании инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов

Код формы по ОКУД 0420514
Месячная

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
31.12.2017	30.11.2017

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	253 217 673.98	304 698 587.80
в том числе:			
на счетах в кредитных организациях	01.01	3 138 906.86	4 566 368.63
на счетах по депозиту в кредитных организациях	01.02	250 078 767.12	300 132 219.17
Ценные бумаги – всего	02	865 363 401.81	500 797 632.63
в том числе:			
облигации – всего	02.01	865 363 401.81	500 797 632.63
в том числе:			
облигации российских хозяйственных обществ	02.01.01	156 235 463.00	153 064 725.00
государственные ценные бумаги Российской Федерации	02.01.02	15 311 371.18	14 966 301.65
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	693 816 567.63	332 766 605.98
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
иностраных акционерных обществ	02.02.02	0.00	0.00
Недвижимое имущество	03	0.00	0.00
Дебиторская задолженность	04	18 716.35	45 719.20
Общая стоимость активов (сумма строк 01 + 02 + 03 + 04)	05	1 118 599 792.14	805 541 939.63
Подраздел «Обязательства»			
Общая величина обязательств	06	479 786 630.27	159 390 703.34
Подраздел «Размер собственных средств»			
Размер собственных средств (разность строк 05 - 06)	07	638 813 161.87	646 151 236.29
Минимальный размер собственных средств			
Минимальный размер собственных средств	08	63 785 635.10	62 901 039.47
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	бн	RUB (Российский рубль)	Расчетный счет	37 779.62	0.00	AKPA AA(RU)	Нет
2	АО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	1326	бн	RUB (Российский рубль)	Расчетный счет	435 607.91	0.04	AKPA AA(RU)	Нет
3	АО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	1326	бн	RUB (Российский рубль)	Расчетный счет	2 665 519.33	0.24	AKPA AA(RU)	Нет
4	АО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	1326	бн	USD (Доллар США)	Расчетный счет	0.00	0.00	AKPA AA(RU)	Нет
5	ПАО "СБЕРБАНК"	1027700132195	1481	01869	RUB (Российский рубль)	Расчетный счет	0.00	0.00	AKPA AAA(RU)	Нет
Итого	X	X	X	X	X	X	3 138 906.86	0.28	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
1	АО "АЛЬФА-БАНК"	1027700067328	1326	бн	RUB (Российский рубль)	09.01.2018	250 078 767.12	22.36	AKPA AA(RU)	Нет
Итого	X	X	X	X	X	X	250 078 767.12	22.36	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	50 102 940.00	4.48	ЭКСПЕРТ RA ruAAA	Нет
2	ПАО "НК "Роснефть"	1027700043502	7706107510	ПУБЛИЧНОЕ АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО	4B02-04-00122-A-001P	RU000A0JXQK2	22.04.2027	100 850.00	106 132 523.00	9.49	ЭКСПЕРТ RA ruAAA	Нет
Итого	X	X	X	X	X	X	X	X	156 235 463.00	13.97	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 и 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	RU000A0JWV30	18.08.2021	5 617.00	5 868 753.94	0.52	BBB- Fitch	Нет
2	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	7710168360	29006RMFS	RU000A0JW4L2	29.01.2025	4 479.00	5 050 341.24	0.45	AKPA AAA(RU)	Нет
3	Министерство финансов Российской Федерации	1037739085636	7710168360	26219RMFS	RU000A0JWM07	16.09.2026	4 200.00	4 392 276.00	0.39	AKPA AAA(RU)	Нет
Итого	X	X	X	X	X	X	X	15 311 371.18	1.36	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, 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	8 312.00	521 351 568.89	46.61	Ba3 Moody's	Нет
2	Alfa Bond Issuance PLC	IRL (Ирландия)	410510	XS1135611652	US01538RAE99	USD (Доллар США)	18.02.2025	1 592.00	105 167 732.30	9.40	B1 Moody's	Нет
3	SB CAPITAL S.A.	LUX (Люксембург)	B115914	XS0848530977	US78406JAC80	USD (Доллар США)	29.10.2022	1 123.00	67 297 266.44	6.02	Ba2 Moody's	Нет
Итого	X	X	X	X	X	X	X	X	693 816 567.63	62.03	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 (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 и 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
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 котировальный список первого (высшего) уровня которой включены акции	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

02.02.02. 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 биржи, в котировальный список первого (высшего) уровня которой включены акции	Эмитент является аффилированным лицом управляющей компании (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	18 716.35	0.00	АКРА AA(RU)	Нет
Итого	X	X	X	X	X	X	18 716.35	0.00	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	72 939 887.80	15.20
2	резерв на выплату премий	Трудовой договор	01.01.1999	Сотрудники компании	XXXXXXXXXX	72 378 271.55	15.09
Итого	X	X	X	X	X	145 318 159.35	30.29

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 бн от 31.12.2017	22.01.2018	АО "АЛЬФА-БАНК"	107078, Москва, ул. Каланчевская, д. 27	1027700067328	47 827 301.95	9.97
2	Услуги по привлечению клиентов в Д.У.	Акт бн от 31.12.2017	25.01.2018	АО "АЛЬФА-БАНК"	107078, Москва, ул. Каланчевская, д. 27	1027700067328	200 111 804.06	41.71
3	Информационные и консультационные услуги, направленные на поиск и привлечение клиентов с целью заключения договоров Д.У.	Акт бн от 31.12.2017	26.01.2018	АО "АЛЬФА-БАНК"	107078, Москва, ул. Каланчевская, д. 27	1027700067328	59 006 456.59	12.30
4	ДМС	Договор добровольного медицинского страхования	01.04.2018	ОАО "АльфаСтрахование"	115162, Г МОСКВА, УЛ ШАБОЛОВКА, Д 31, СТР Б.	1027739431730	2 248 934.61	0.47
5	ДМС	Договор добровольного медицинского страхования	01.07.2018	ОАО "АльфаСтрахование"	115162, Г МОСКВА, УЛ ШАБОЛОВКА, Д 31, СТР Б.	1027739431730	2 273 648.18	0.47
6	ДМС	Договор добровольного медицинского страхования	01.10.2018	ОАО "АльфаСтрахование"	115162, Г МОСКВА, УЛ ШАБОЛОВКА, Д 31, СТР Б.	1027739431730	2 273 648.18	0.47
Итого	X	X	X	X	X	X	313 741 793.57	65.39

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