

ПОЯСНИТЕЛЬНАЯ ЗАПИСКА
к справке о стоимости чистых активов

Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций "Альфа-Капитал Баланс"

(далее - паевой инвестиционный фонд)

на 30 сентября 2015 г.

1. Настоящая Пояснительная записка составлена в соответствии с Приказом ФСФР от 15 июня 2005 г. N 05-21/пз-н «ОБ УТВЕРЖДЕНИИ 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» (далее – положение).
2. В 3 квартале 2015 года возникли забалансовые риски, не включенные в расчет СЧА, в связи с заключением фьючерсных контрактов. Сведения о финансовых инструментах по фьючерсным контрактам: : Фьючерсный контракт на курс доллар США - российский рубль USD-12.15. На 30.09.2015г. открыта короткая позиция по фьючерсному контракту USD-12.15, в количестве 2 275 штук.
3. В состав активов паевого инвестиционного фонда за отчетный период не входили требования и обязательства, не включаемые в расчет стоимости чистых активов, в том числе, активы, обремененные залогом, опционы, фьючерсные и форвардные контракты, премии по опционам, отсутствовали забалансовые риски.
4. По состоянию на 30.09.2015 года отсутствуют объявленные, но не полученные суммы дивидендов по акциям, составляющим активы паевого инвестиционного фонда.
5. В течение отчетного периода на стоимость чистых активов паевого инвестиционного фонда существенное влияние оказали изменения котировок следующих ценных бумаг, составляющих активы паевого инвестиционного фонда:

<i>ценная бумага</i>	<i>котировка</i>				<i>изменение в %</i>
	<i>дата</i>		<i>дата</i>		
DBX EM LIQ EUR BOND EUR	30.06.2015	18 548,460900	30.09.2015	21 913,830200	18,14
DIREXION DLY EMG MKT BULL 3X	30.06.2015	1 211,533700	30.09.2015	737,214500	-39,15
GAZ CAPITAL S.A. 9.25 23/04/19	30.06.2015	6 175,379300	30.09.2015	7 342,603100	18,90
McDonald's	30.06.2015	5 299,210600	30.09.2015	6 456,753500	21,84
Metalloinvest Finance Ltd 5.625 17/04/20	30.06.2015	5 122,422100	30.09.2015	6 267,316600	22,35
Novatek Finance 4.422 13/12/22	30.06.2015	4 794,941600	30.09.2015	5 740,602300	19,72
OFCB Capital PLC. 10.00 26/04/19	30.06.2015	5 457,787100	30.09.2015	6 615,390400	21,21
POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	03.09.2015	491,500000	30.09.2015	565,000000	14,95
PROSHARES ULTRA 20+ YEAR TSY	30.06.2015	3 923,881100	30.09.2015	5 141,955000	31,04
ProShares Ultra Gold	30.06.2015	2 086,591900	25.08.2015	2 526,357500	21,08
PROSHARES ULTRA OIL & GAS	30.06.2015	2 639,611000	30.09.2015	1 971,204200	-25,32
SB CAPITAL S.A. 5.125 29/10/22	30.06.2015	4 785,002800	25.08.2015	5 685,188700	18,81
SCHWAB US REIT ETF	30.06.2015	2 013,855500	30.09.2015	2 446,121300	21,46
Sibur Securities Limited 3.914 31/01/2018	30.06.2015	5 208,873000	30.09.2015	6 390,053200	22,68
ФосАгро а.о. 2 д.в.	30.06.2015	2 066,000000	30.09.2015	2 741,000000	32,67

Генеральный директор

_____/ Кривошеева Ирина Владимировна /
(подпись)

Заместитель руководителя Управления учета бизнес-операций

_____/ Маркова Юлия Сергеевна /
(подпись)

Начальник Специализированного депозитария АО "Альфа-Банк"
Акционерное общество «Альфа-Банк»

_____/ Калинихина Елена Николаевна /
(подпись)