

Раздел I. Реквизиты управляющей компании

1. Полное наименование управляющей компании: Открытое акционерное общество "РОНИН Траст"

2. Номер лицензии управляющей компании: 21-000-1-00100

Раздел II. Параметры расчета собственных средств

Текущая отчетная дата: 30.09.2016

Предыдущая отчетная дата: 31.08.2016

Раздел III. Расчет собственных средств

Таблица: Расчет собственных средств

1	2	3	4
Подраздел «Активы, принятые к расчету собственных средств»			
Денежные средства – всего	01	3 043 786,89	0,00
в том числе:			
на счетах в кредитных организациях	01.01	3 043 786,89	0,00
на счетах по депозиту в кредитных организациях	01.02	0,00	0,00
Ценные бумаги – всего	02	1 209 887 393,98	0,00
в том числе:			
облигации – всего	02.01	1 209 887 393,98	0,00
в том числе:			
облигации российских хозяйственных обществ	02.01.01	225 375 124,44	0,00
государственные ценные бумаги Российской Федерации	02.01.02	984 512 269,54	0,00
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	0,00	0,00
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	0,00	0,00
Общая стоимость активов (сумма строк 01 + 02 + 03 + 04)	05	1 212 931 180,87	0,00
Подраздел «Обязательства»			
Общая величина обязательств	06	876 023 260,05	0,00
Размер собственных средств			
Размер собственных средств		0,00	0,00
(разность строк 05 - 06)	07	336 907 920,82	0,00

Минимальный размер собственных средств			
Минимальный размер собственных средств	08	35 000 000,00	0,00
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

Таблица: 01.01. Денежные средства на счетах в кредитных организациях

Номер строки	Наименование кредитной организации (полное наименование, ОГРН/ОГРНИП, ИНН/ОГРН)	ИНН кредитной организации	Регистрационный номер кредитной организации	Подписанные документами государственного образца	Курс валюты счета	Вид валютного счета (расчетный/другой)	Сумма вклада, в рублях	Дата отобранной информации о состоянии вклада (днем до истечения срока вклада)	Рейтинг международной кредитной организации, в том числе рейтинг от ее филиала	Классификация кредитной организации по эффективности управления активами / рискам
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
1	ПАО МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК	1027739555282	1978	а	RUB (Россия)	расчетный	3 043 786,89 3 043 786,89	0,25	BB, Fitch Ratings	Нет
Итого	х	х	х	х	х	х	786,89	0,25	х	х

02.01.01. Облигации российских хозяйственных обществ

Таблица: 02.01.01. Облигации российских хозяйственных обществ

Номер строки	Наименование эмитента	ОГРН эмитента	ИНН эмитента	Организационно-правовая форма эмитента	Государственный регистрационный номер эмиссионной облигации	Код (ISIN) ценной бумаги	Дата погашения	Лицевой счет облигации, счета	Сумма облигации в рублях	Дата отобранной информации о состоянии облигации (днем до истечения срока вклада)	Рейтинг международной кредитной организации (агентства, получившая сертификат), в том числе рейтинг от ее филиала	Классификация облигации по эффективности управления активами / рискам
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
1	РУСФИНАНС БАНК	1026300001991	5012003647	ООО	4B020701792B	RU000A0JTVN4	24.04.2018	11 111	12 030 435,25	0,99	BBB-, Fitch Ratings	Нет
2	РОСНАНО	1117799004333	7728131587	ОАО	4-05-55477-E	RU000A0JS6T5	10.04.2019	23 253	23 468 555,31	1,93	BB-, Standard & Poor's	Нет

3	РОСНАНО	1117799004333	7728131587	ОАО	4-04-55477-E	RU000A0JS6S7	10.04.2019	1 722	1 720 742,94	0,14	BB-, Standard & Poor's	Her
4	МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК	1027739555282	7734202860	ПАО	41101978B	RU000A0JTF50	05.06.2018	85 000	88 230 000	7,27	BB, Fitch Ratings	Her
5	ИНГ БАНК	1027739329375	7712014310	АО	4B020502495B	RU000A0JVFJ1	27.05.2020	555	562 192,8	0,05	BBB-, Fitch Ratings	Her
6	ИКС 5 ФИНАНС	1067761792053	7715630469	ООО	4B02-03-36241-R	RU000A0JU8X9	26.10.2016	37 744	39 126 185,28	3,23	BB-, Fitch Ratings	Her
7	ЕВРАЗХОЛДИНГ ФИНАНС	1097746549515	7707710865	ООО	4B02-01-36383-R-001P	RU000A0JWBH2	23.03.2021	197	208 217,18	0,02	BB-, Standard & Poor's	Her
8	ГАЗПРОМ КАПИТАЛ	1087746212388	7726588547	ООО	4-05-36400-R	RU000A0JTNC4	16.02.2017	14 600	14 620 294	1,21	BBB-, Fitch Ratings	Her
9	ВЭБ-ЛИЗИНГ	1037709024781	7709413138	ОАО	4-22-43801-H	RU000A0JU9S7	06.11.2018	10 001	6 222 622,2	0,51	BBB-, Fitch Ratings	Her
10	ВНЕШЭКОНОМБАНК	1077711000102	7750004150	Государственное предприятие	4-26-00004-T	RU000A0JS4Z7	17.02.2032	1 400	1 416 492	0,12	BBB-, Fitch Ratings	Her
11	АЛЬФА-БАНК	1027700067328	7728168971	АО	4B021101326B	RU000A0JUQA9	30.06.2017	26 000	26 783 640	2,21	BB+, Fitch Ratings	Her
12	АИЖК	1027700262270	7729355614	АО	4-08-00739-A	RU000A0JNPK5	15.06.2018	22 222	6 540 823,48	0,54	BB+, Standard & Poor's	Her
13	АИЖК	1027700262270	7729355614	АО	4-15-00739-A	RU000A0JQAM6	15.09.2028	1 200	1 249 008	0,1	BB+, Standard & Poor's	Her
14	АИЖК	1027700262270	7729355614	АО	4-13-00739-A	RU000A0JQAG8	15.04.2018	2 900	3 195 916	0,26	BB+, Standard & Poor's	Her
Итого	x	x	x	x	x	x	x	x	225 375 124,44	18,58	x	x

02.01.02. Государственные ценные бумаги Российской Федерации

Таблица: 02.01.02. Государственные ценные бумаги Российской Федерации

Номер строки	Наименование ценной бумаги	ИДН ЦФА	ИНТ	ОБЛ	Код облигации	Дата выпуска	Дата погашения	Количество в составе портфеля ценных бумаг	Стоимость облигации в рублях	Доля от общей стоимости активов	Категория облигации	Итого
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
1	МИНФИН РОССИИ	1037739085636	7710168360	29011RMFS	RU000A0JV7J9	29.01.2020	444 444	467 019 088,54	38,5	BBB-, Fitch Ratings	Her	
2	МИНФИН РОССИИ	1037739085636	7710168360	25080RMFS	RU000A0JS751	19.04.2017	249 000	255 055 431	21,03	BBB-, Fitch Ratings	Her	
3	МИНФИН РОССИИ	1037739085636	7710168360	24018RMFS	RU000A0JV7K7	27.12.2017	250 000	262 437 750	21,64	BBB-, Fitch Ratings	Her	
Итого	x	x	x	x	x	x	x	984 512 269,54	81,17	x	x	x

Расшифровки строки 06 подраздела «Обязательства»

06.02. Кредиторская задолженность (кредитор – юридическое лицо)

Таблица: 06.02. Кредиторская задолженность (кредитор – юридическое лицо)

1	2	3	4	5	6	7	8	9
1	Долгосрочный займ	Договор займа от 17.04.15	25.04.2020	JOBO ENTERPRISES LIMITED SKYROU	Кипр	HE195634	770 000 000	87,9
2	Проценты по займу	Договор займа от 17.04.15	31.03.2017	JOBO ENTERPRISES LIMITED SKYROU	Кипр	HE195634	100 590 191,25	11,48
Итого	x	x	x	x	x	x	870 590 191,25	99,38

Пояснительная записка к справке о стоимости чистых активов

1. Сведения об активах, принятых к расчету собственных средств, которые переданы в доверительное управление : Нет
2. Сведения об обязательствах по сделкам, заключённым в рамках доверительного управления, принятых к расчету собственных средств: Нет
3. Сведения о событиях, в результате которых в течение отчетного месяца размер собственных средств изменился более чем на 10% : Нет
4. Иная информация: Нет

Сопроводительное письмо

Код территории по ОКАТО: 45375000

Идентификационный номер налогоплательщика (ИНН): 7709379423

Основной государственный регистрационный номер (ОГРН): 1027739348999

Полное наименование организации: Открытое акционерное общество "РОНИН Траст"

Сокращенное наименование организации: ОАО "РОНИН Траст"

Отчетный месяц: сентябрь

Отчетный год: 2016

Дата исходящего документа: 12.10.2016

Краткое содержание письма: Расчет собственного капитала УК ПИФ

Исходящий номер: 03-вд/1342

Руководитель управляющей компании

Фамилия: Стукалов

Имя: Сергей

Отчество: Александрович

Должность: Генеральный директор

Контактный телефон: (495)6438881

Дата: М.П.

