



# ЦЕРИХ

Новые технологии дохода.

**Инвестиционная стратегия:** Облигационный доход

**Инвестиционные цели:** Прирост капитала и доход

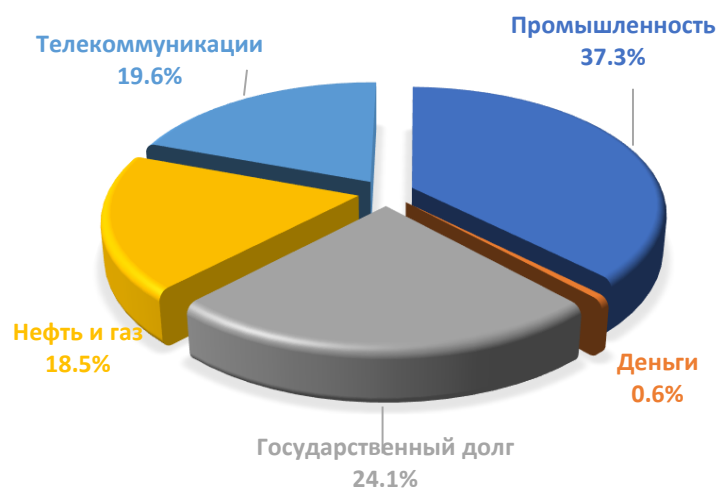
**Риск-профиль:** Консервативный

**Бенчмарк:** Доходность рублевых вкладов, исходя из рассчитываемых ЦБ РФ средневзвешенных процентных ставок по привлеченным кредитными организациями вкладам (депозитам) физических лиц в рублях сроком до 1 года, кроме "до востребования" (по 30 крупнейшим банкам)

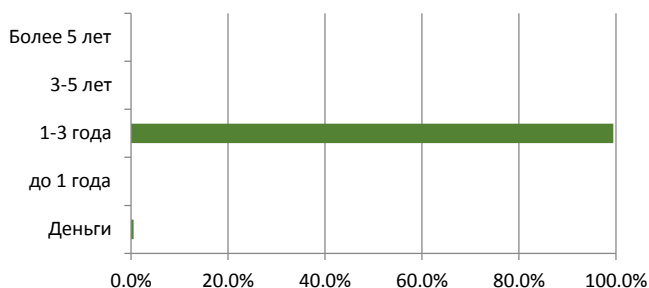
**Отчетная дата:** 30 сентября 2020 г.



## СТРУКТУРА ПОРТФЕЛЯ НА 30.09.2020



## Распределение активов по дюрации



Начало управления портфелем 31.12.2016

Данные статистического анализа	
Стандартное отклонение	3.71%
Коэффициент Шарпа	1.52

## Результаты накопленным итогом:

Период	1 месяц	3 месяца	1 год	С начала управления, % абс	С начала управления, % год.
Портфель	0.5%	1.0%	9.7%	44.1%	10.2%
Бенчмарк	0.3%	0.9%	4.4%	22.1%	5.5%

## Результаты за календарный год

Период	2018	2019	2020
Портфель	2.6%	16.8%	5.2%
Бенчмарк	5.5%	5.6%	3.2%

АО ИК «ЦЕРИХ Капитал Менеджмент»

Лицензии ФКЦБ России без ограничения срока действия на осуществление деятельности по управлению ценными бумагами № 045-04091-001000 от 21.12.2000 года

Настоящая информация не является гарантией или обещанием в будущем доходности вложений.

Доходности указаны на основании данных по одному из портфелей клиентов. Состав активов в каждом инвестиционном портфеле, управляемом в соответствии с данной стратегией, может варьироваться в зависимости от объема и срока вложений, оставаясь в рамках инвестиционной декларации.