



# ЦЕРИХ

Новые технологии дохода.

**Инвестиционная стратегия:** Облигационный доход

**Инвестиционные цели:** Прирост капитала и доход

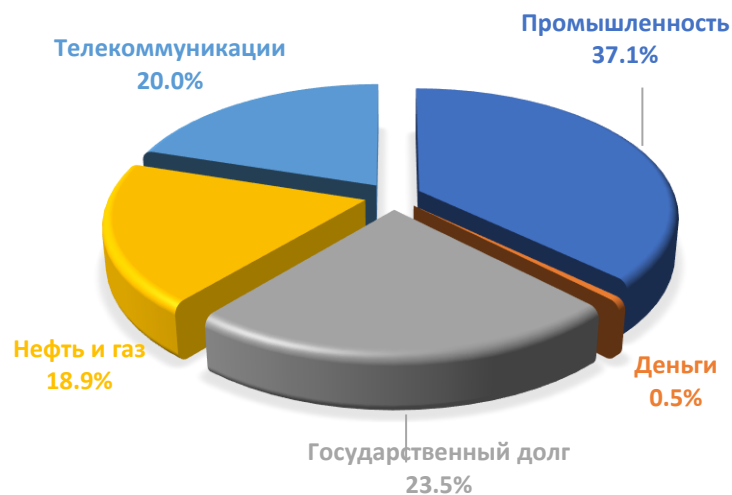
**Риск-профиль:** Консервативный

**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)

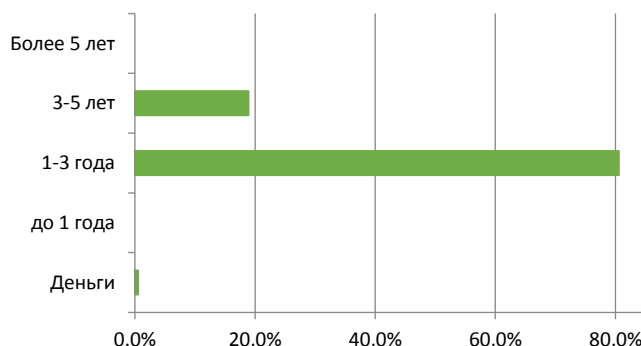
**Отчетная дата:** 30 июня 2020 г.



СТРУКТУРА ПОРТФЕЛЯ НА 30.06.2020



Распределение активов по дюрации



Данные статистического анализа	
Стандартное отклонение	3.81%
Коэффициент Шарпа	1.41

Результаты накопленным итогом:

Период	1 месяц	3 месяца	1 год	С начала управления, % абс	С начала управления, % год.
Портфель	0.7%	5.8%	12.9%	42.6%	10.7%
Бенчмарк	0.4%	1.2%	5.0%	21.1%	5.6%

Результаты за календарный год

Период	2018	2019	2020
Портфель	2.6%	16.8%	4.1%
Бенчмарк	5.5%	5.6%	2.3%

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.