



ЦЕРИХ

Новые технологии дохода.

Инвестиционная стратегия: Облигационный доход ПЛЮС

Инвестиционные цели: Прирост капитала и доход

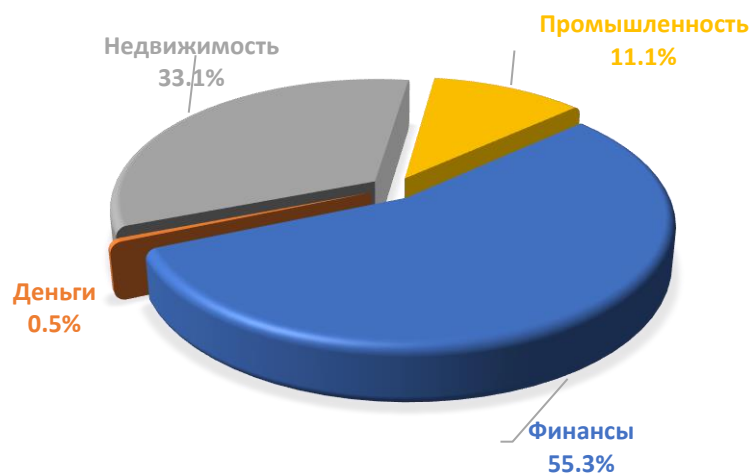
Риск-профиль: Умеренный

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)

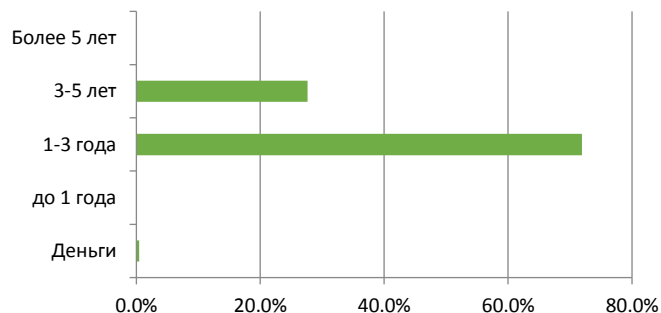
Отчетная дата: 30 сентября 2020 г.



СТРУКТУРА ПОРТФЕЛЯ НА 30.09.2020



Распределение активов по дюрации



Данные статистического анализа

Стандартное отклонение	5.29%
Коэффициент Шарпа	1.02

Результаты накопленным итогом:

Период	1 месяц	3 месяца	1 год	С начала управления, % абс	С начала управления, % год.
Портфель	1.4%	3.4%	9.6%	42.6%	9.9%
Бенчмарк	0.3%	0.9%	4.4%	22.1%	5.5%

Результаты за календарный год

Период	2018	2019	2020
Портфель	1.8%	15.2%	5.0%
Бенчмарк	5.5%	5.6%	3.2%

АО ИК «ЦЕРИХ Кэпитал 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.