



ЦЕРИХ

Новые технологии дохода.

Инвестиционная стратегия: Российские Акции

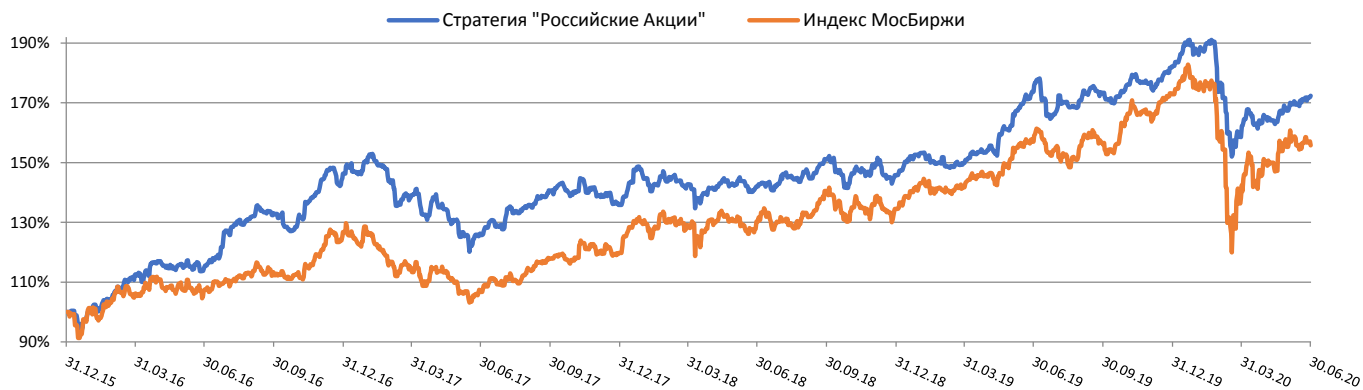
Риск-профиль: Агрессивный

Отчетная дата: 30 июня 2020 г.

Инвестиционные цели:

Прирост капитала путем инвестирования средств в акции российских акционерных обществ.

Бенчмарк: Индекс МосБиржи



СТРУКТУРА ПОРТФЕЛЯ НА 30.06.2020



Самые крупные позиции в портфеле

Эмитент	Сектор	Доля
Минфин России	Государственный долг	25.1%
ПАО Сургутнефтегаз	Нефть и газ	11.8%
ПАО Газпром	Нефть и газ	8.4%
ПАО Ростелеком	Телекоммуникации	7.8%
ПАО Группа ЛСР	Недвижимость	5.2%

Данные статистического анализа

Стандартное отклонение	13.08%
Коэффициент Шарпа	0.62
Бета	0.82

Результаты накопленным итогом:

Период	1 месяц	3 месяца	1 год	С начала управления, % абс	С начала управления, % год.
Портфель	3.0%	6.3%	-0.8%	72.3%	12.9%
Бенчмарк	0.3%	9.3%	-0.8%	55.7%	10.4%

Результаты за календарный год

Период	2018	2019	2020
Портфель	7.3%	25.1%	-5.5%
Бенчмарк	12.3%	28.6%	-9.9%

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.