



ЦЕРИХ

Новые технологии дохода.

Инвестиционная стратегия: Российские Акции

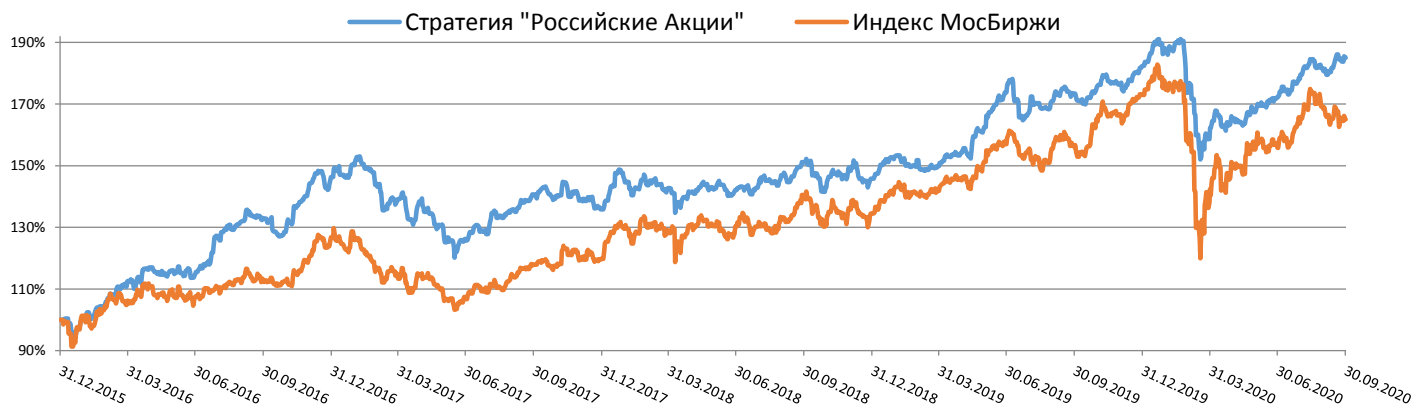
Риск-профиль: Агрессивный

Отчетная дата: 30 сентября 2020 г.

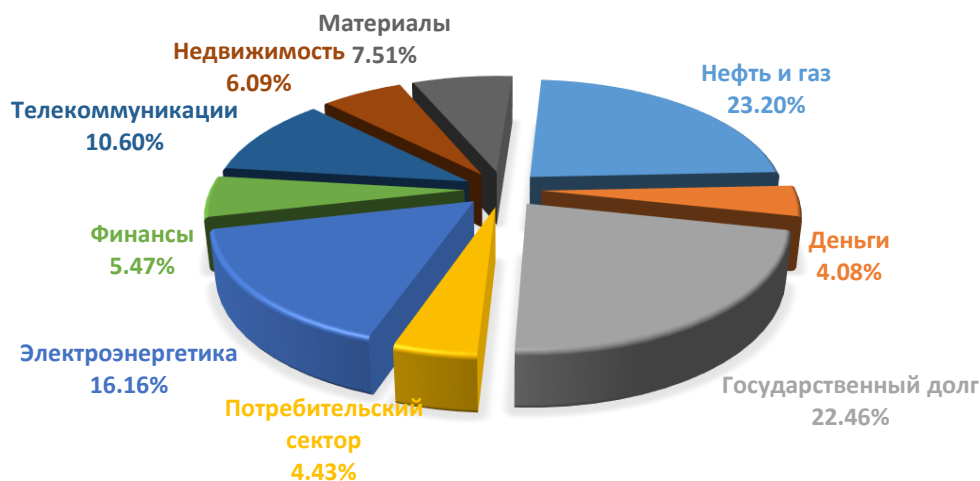
Инвестиционные цели:

Прирост капитала путем инвестирования средств в акции российских акционерных обществ.

Бенчмарк: Индекс МосБиржи



СТРУКТУРА ПОРТФЕЛЯ НА 30.09.2020



Самые крупные позиции в портфеле

Эмитент	Сектор	Доля
Минфин России	Государственный долг	22.5%
ПАО Сургутнефтегаз	Нефть и газ	13.5%
ПАО Газпром	Нефть и газ	9.7%
ПАО Ростелеком	Телекоммуникации	8.2%
ПАО Группа ЛСР	Недвижимость	6.1%

Данные статистического анализа	
Стандартное отклонение	12.82%
Коэффициент Шарпа	0.75
Бета	0.79

Результаты накопленным итогом:

Период	1 месяц	3 месяца	1 год	С начала управления, % абс	С начала управления, % год.
Портфель	2.3%	7.3%	6.8%	84.9%	13.8%
Бенчмарк	-2.0%	5.9%	5.8%	65.0%	11.1%

Результаты за календарный год

Период	2018	2019	2020
Портфель	7.3%	25.1%	1.4%
Бенчмарк	12.3%	28.6%	-4.6%

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.