



ЦЕРИХ

Новые технологии дохода.

Инвестиционная стратегия: Облигационный доход

Инвестиционные цели: Прирост капитала и доход

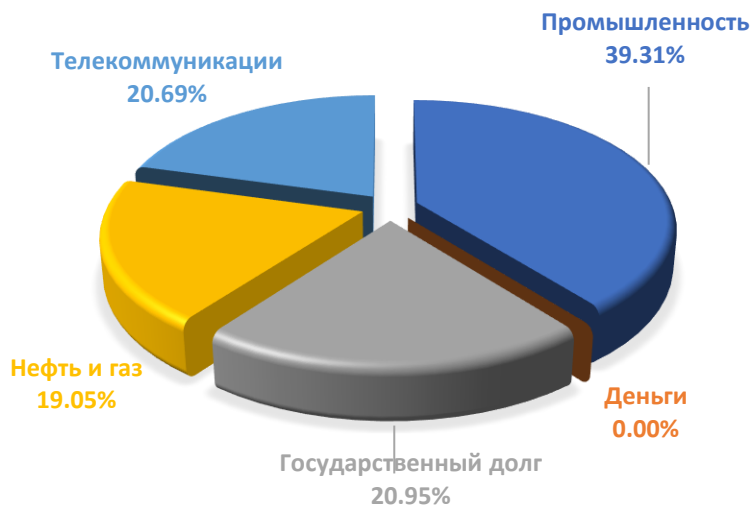
Риск-профиль: Консервативный

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)

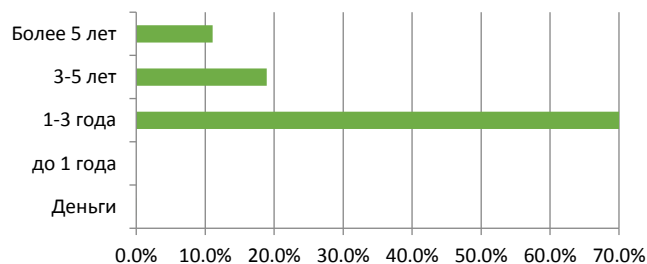
Отчетная дата: 31.12.2019



СТРУКТУРА ПОРТФЕЛЯ НА 31.12.2019



Распределение активов по дюрации



Начало управления портфелем 31.12.2016

Данные статистического анализа	
Стандартное отклонение	3.5%
Коэффициент Шарпа	1.34

Результаты накопленным итогом:

Период	1 месяц	3 месяца	1 год	С начала управления, % абс	С начала управления, % год.
Портфель	1.7%	4.3%	16.8%	37.0%	11.1%
Бенчмарк	0.4%	1.3%	5.7%	18.4%	5.8%

Результаты за календарный год

Период	2017	2018	2019
Портфель	14.3%	2.6%	16.8%
Бенчмарк	6.2%	5.5%	5.7%

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.