



# ЦЕРИХ

Новые технологии дохода.

**Инвестиционная стратегия:** Облигационный доход ПЛЮС

**Инвестиционные цели:** Прирост капитала и доход

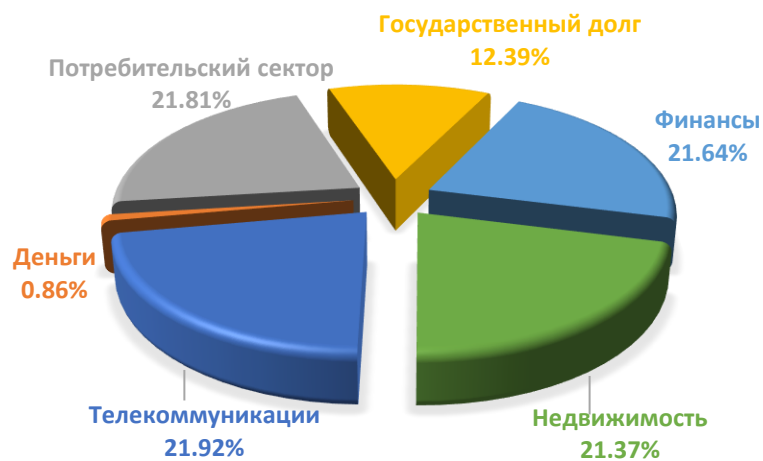
**Риск-профиль:** Умеренный

**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)

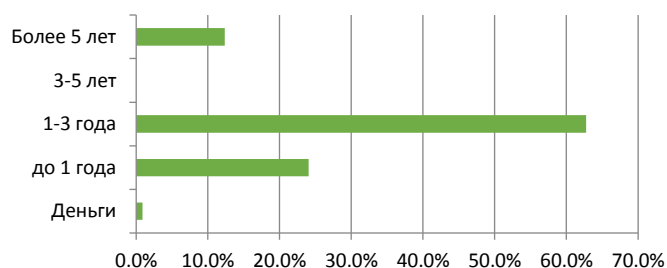
**Отчетная дата:** 31.12.2019



СТРУКТУРА ПОРТФЕЛЯ НА 31.12.2019



Распределение активов по дюрации



Начало управления портфелем 31.12.2016

Данные статистического анализа	
Стандартное отклонение	4.4%
Коэффициент Шарпа	1.01

Результаты накопленным итогом:

Период	1 месяц	3 месяца	1 год	С начала управления, % абс	С начала управления, % год.
Портфель	1.5%	4.3%	15.2%	35.7%	10.7%
Бенчмарк	0.4%	1.3%	5.7%	18.4%	5.8%

Результаты за календарный год

Период	2017	2018	2019
Портфель	15.7%	1.8%	15.2%
Бенчмарк	6.2%	5.5%	5.7%

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.