



ЦЕРИХ

Новые технологии дохода.

Инвестиционная стратегия: Российские Акции

Риск-профиль: Агрессивный

Отчетная дата: 31.12.2019

Инвестиционные цели:

Прирост капитала путем инвестирования средств в акции российских акционерных обществ.

Бенчмарк: Индекс МосБиржи



СТРУКТУРА ПОРТФЕЛЯ НА 31.12.2019



Самые крупные позиции в портфеле

Эмитент	Сектор	Доля
Минфин России	Государственный долг	18.5%
ПАО Газпром	Нефть и газ	15.6%
ПАО Сургутнефтегаз	Нефть и газ	10.3%
ПАО Группа ЛСР	Недвижимость	7.2%
ПАО Детский мир	Потребительский сектор	7.1%

Данные статистического анализа

Стандартное отклонение	12.54%
Коэффициент Шарпа	0.79
Бета	0.89

Результаты накопленным итогом:

Период	1 месяц	3 месяца	1 год	С начала управления, % абс	С начала управления, % год.
Портфель	3.3%	5.3%	25.1%	82.3%	16.2%
Бенчмарк	3.8%	10.9%	28.6%	72.9%	14.7%

Результаты за календарный год

Период	2017	2018	2019
Портфель	-7.2%	7.3%	25.1%
Бенчмарк	-5.5%	12.3%	28.6%

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.