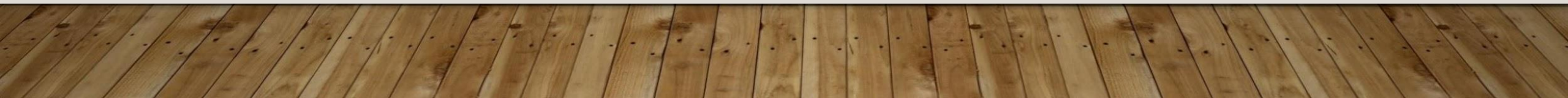


ЛАБОРАТОРНАЯ РАБОТА №1 ПО РЦБ

ЕВСТИГНЕЕВ СЕМЕН

С16-713



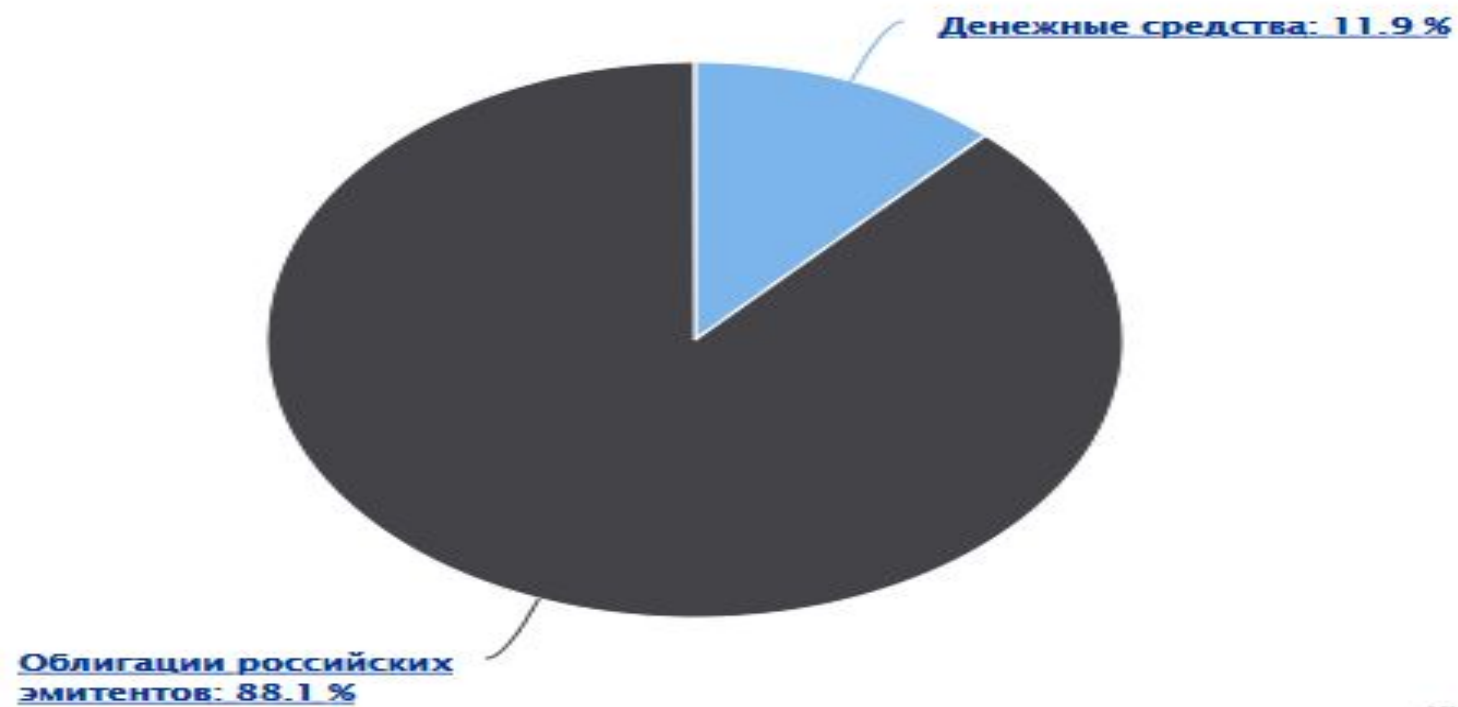
ИНГОССТРАХ ДЕНЕЖНЫЙ РЫНОК

Общая информация:

- Управляющая компания – Ингосстрах - Инвестиции
- Номер регистрации – 1148-94139715
- Дата регистрации – 27.12.2007
- Формирование – с 01.02.2008 до 21.04.2008
- Пайщики на 29.06.2018 – 36

СТРУКТУРА:

Ингосстрах денежный рынок



Коэффициент	Значение	Позиция
Коэффициент Шарпа	-0.075	208
Коэффициент Сортино	-0.074	203
Волатильность	3.06%	100
VaR	-4.69%	137
α -коэффициент	-7.103	
β -коэффициент	-0.196	
R2	4.54%	

ОБРАЩЕНИЕ ДЕНЕЖНЫХ СРЕДСТВ

ДАТА	ПАЙ	СЧА	ДАТА	ПАЙ	СЧА	ДАТА	ПАЙ	СЧА
05.12.2018	7 625.41	540 225 658.97	21.11.2018	7 607.57	538 961 771.33	07.11.2018	7 592.71	537 909 146.02
04.12.2018	7 620.71	539 892 547.33	20.11.2018	7 605.59	538 821 393.49	06.11.2018	7 588.11	537 583 628.87
03.12.2018	7 618.38	539 727 475.13	19.11.2018	7 603.13	538 647 174.01	02.11.2018	7 578.47	535 870 261.07
30.11.2018	7 617.88	539 692 608.63	16.11.2018	7 608.41	539 021 288.43	01.11.2018	7 582.17	536 131 952.53
29.11.2018	7 623.88	540 117 404.67	15.11.2018	7 604.23	538 725 300.56	31.10.2018	7 582.79	536 175 848.08
28.11.2018	7 608.50	539 027 783.38	14.11.2018	7 603.01	538 638 765.15	30.10.2018	7 577.64	535 811 414.85
27.11.2018	7 613.62	539 390 715.03	13.11.2018	7 596.25	538 159 852.73	29.10.2018	7 576.20	535 709 693.08
26.11.2018	7 609.16	539 074 844.46	12.11.2018	7 592.27	537 877 903.70	26.10.2018	7 580.73	536 030 066.70
23.11.2018	7 611.41	539 233 949.52	09.11.2018	7 586.31	537 455 995.23	25.10.2018	7 570.25	535 288 783.68
22.11.2018	7 609.98	539 132 921.89	08.11.2018	7 582.97	537 218 918.38	24.10.2018	7 572.04	535 416 008.46

СТОИМОСТЬ ИЗМЕНЕНИЯ ЦЕНЫ ПИФА:

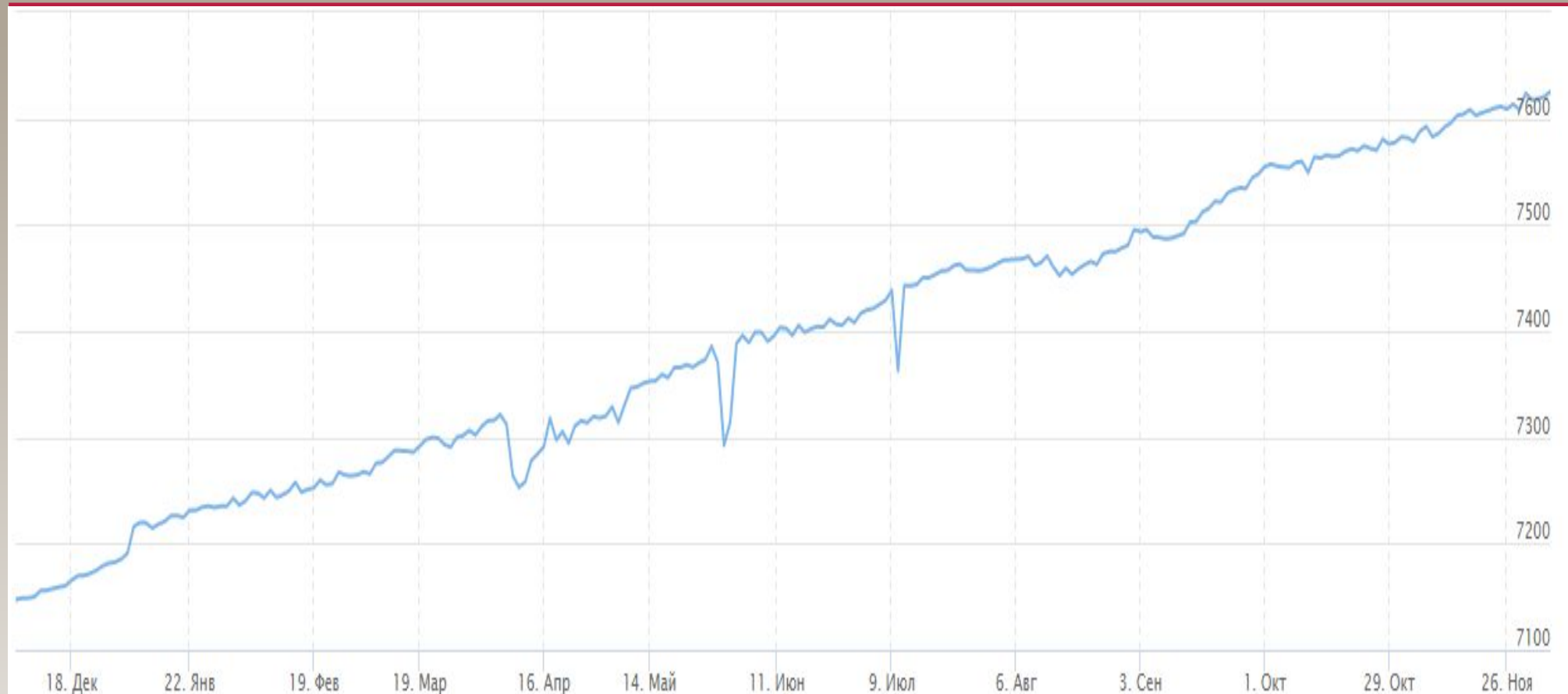
Минимальная сумма инвестирования

- Первоначальный взнос: 5 000 RUB
- Последующий взнос: 1 000 RUB

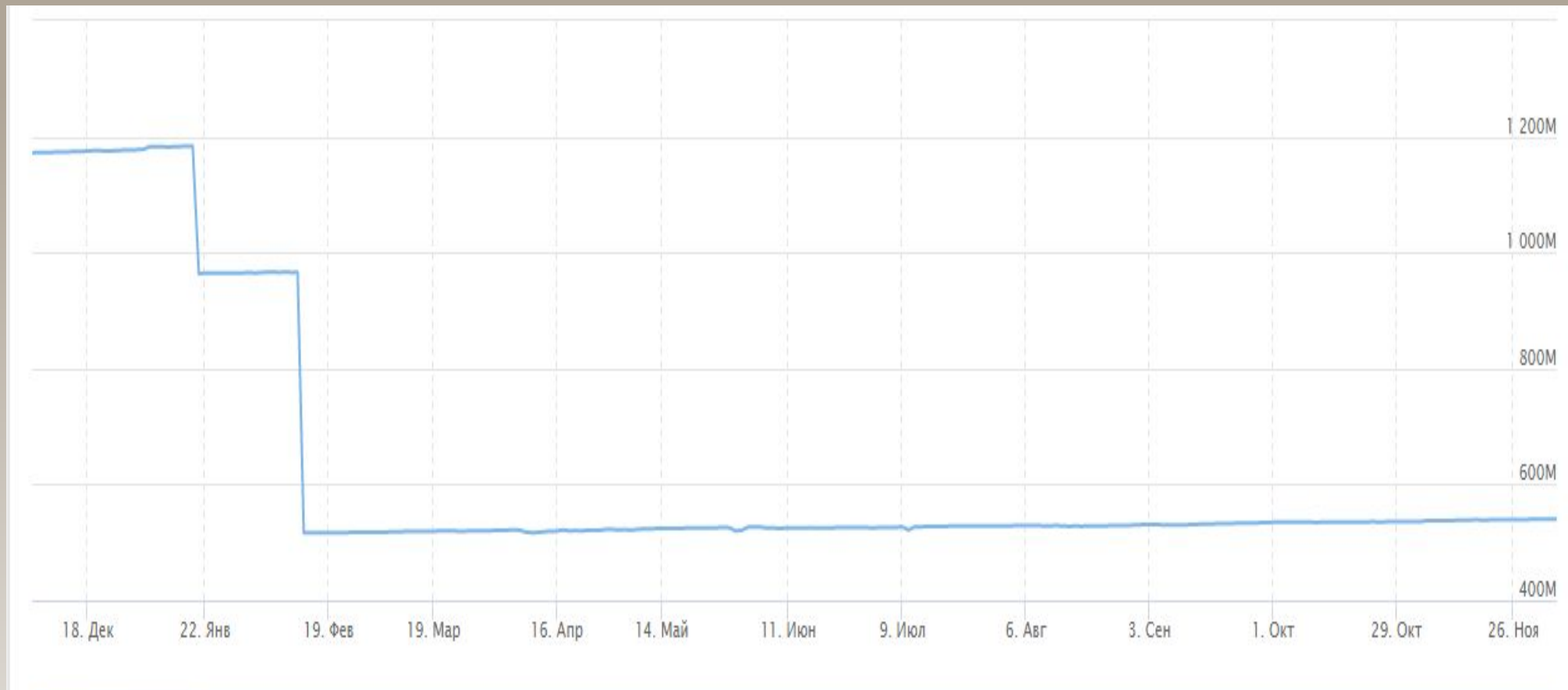
Инфраструктурные расходы

- Вознаграждение УК: 0.45%
- Вознаграждение депозитарию и др.: 0.4% с учетом НДС
- Прочие расходы: 0.1% с учетом НДС

ДИНАМИКА СТОИМОСТИ ПАЯ



ДИНАМИКА СТОИМОСТИ



ВЫВОД:

Фонд рассчитан на консервативных инвесторов, нацелен на обеспечение доходности выше, чем по среднему банковскому депозиту.

Портфель фонда включает в себя депозиты российских банков с высоким кредитным качеством.

ВТБ – ФОНД ДЕНЕЖНОГО РЫНКА

Общая информация:

- Управляющая компания – ВТБ Капитал Управление активами
- Номер регистрации – 0997-94132239
- Дата регистрации – 25.09.2007
- Формирование – с 29.10.2007 до 07.12.2007
- Пайщики на 29.06.2018 – 330

СТРУКТУРА:



КОЭФФИЦИЕНТ		ПОЗИЦИЯ / 254 ФОНДА
Коэффициент Шарпа	0.143	99
Коэффициент Сортино	0.142	105
Волатильность	0.22%	1
VaR	0.20%	1
α -коэффициент	-5.679	
β -коэффициент	0.014	
R2	4.51%	

ОБРАЩЕНИЕ ДЕНЕЖНЫХ СРЕДСТВ:

ДАТА	ПАЙ	СЧА	ДАТА	ПАЙ	СЧА	ДАТА	ПАЙ	СЧА
05.12.2018	1 994.02	104 479 480.98	21.11.2018	1 988.53	114 732 003.54	07.11.2018	1 981.74	153 753 237.56
04.12.2018	1 994.79	106 596 567.82	20.11.2018	1 988.81	111 956 070.55	06.11.2018	1 981.91	159 678 595.79
03.12.2018	1 995.39	109 923 004.45	19.11.2018	1 990.40	124 638 978.36	02.11.2018	1 980.55	153 573 922.77
30.11.2018	1 993.34	109 774 490.37	16.11.2018	1 989.27	125 652 353.31	01.11.2018	1 980.43	162 159 022.44
29.11.2018	1 993.48	113 893 656.93	15.11.2018	1 988.75	127 209 916.10	31.10.2018	1 980.17	162 469 026.38
28.11.2018	1 990.26	113 744 219.15	14.11.2018	1 986.04	135 587 714.15	30.10.2018	1 979.50	162 433 937.06
27.11.2018	1 990.09	112 205 385.26	13.11.2018	1 980.65	135 354 453.90	29.10.2018	1 980.12	162 364 177.38
26.11.2018	1 987.31	113 249 376.87	12.11.2018	1 981.85	152 956 472.59	26.10.2018	1 979.18	162 297 796.48
23.11.2018	1 988.76	114 602 974.27	09.11.2018	1 980.37	155 108 118.47	25.10.2018	1 979.33	160 326 282.23
22.11.2018	1 989.51	114 675 786.37	08.11.2018	1 980.38	154 956 981.31	24.10.2018	1 978.92	172 695 989.03

СТОИМОСТЬ ИЗМЕНЕНИЯ ЦЕНЫ ПИФА:

Минимальная сумма инвестирования

- Первоначальный взнос: 5 000 RUB
- Последующий взнос: 1 000 RUB

Инфраструктурные расходы

- Вознаграждение УК: 1%
- Вознаграждение депозитарию и др.: 0.7% с учетом НДС
- Прочие расходы: 1.5% с учетом НДС

ДИНАМИКА СТОИМОСТИ ПДЯ



ДИНАМИКА СТОИМОСТИ СЧА



ВЫВОД:

Цель инвестирования - размещение средств фонда на рынке инструментов с фиксированной доходностью с фокусом на обеспечение сохранности капитала. Управляющий стремится улучшить для клиентов фонда соотношение риск-доходность за счет кредитной экспертизы и управления короткой дюрацией в зависимости от мнения управляющего относительно динамики краткосрочных рыночных процентных ставок.

УРАЛСИБ ГЛОБАЛЬНЫЕ ИННОВАЦИИ

Общая информация:

- Управляющая компания – УРАЛСИБ
- Номер регистрации – 1142-94140995
- Дата регистрации – 27.12.2007
- Формирование – с 03.03.2008 до 11.03.2008
- Пайщики на 29.06.2018 – 353

СТРУКТУРА:



Коэффициент	Значение	Позиция
Коэффициент Шарпа	0.034	157
Коэффициент Сортино	0.036	157
Волатильность	3.87%	175
VaR	-5.63%	180
α -коэффициент	-3.294	
β -коэффициент	0.422	
R2	12.95%	

ОБРАЩЕНИЕ ДЕНЕЖНЫХ СРЕДСТВ:

ДАТА	ПАЙ	СЧА	ДАТА	ПАЙ	СЧА	ДАТА	ПАЙ	СЧА
05.12.2018	24 641.57	156 563 085.00	21.11.2018	23 650.11	149 829 048.00	07.11.2018	26 077.73	162 610 302.00
04.12.2018	24 481.40	155 545 419.00	20.11.2018	23 523.48	149 026 816.00	06.11.2018	25 392.49	158 163 281.00
03.12.2018	25 624.16	162 806 127.00	19.11.2018	23 854.55	150 255 303.00	02.11.2018	25 462.13	158 319 829.00
30.11.2018	25 193.67	160 070 907.00	16.11.2018	24 974.22	157 309 280.00	01.11.2018	25 873.97	160 880 608.00
29.11.2018	24 980.80	159 095 884.00	15.11.2018	25 794.08	162 905 443.00	31.10.2018	25 380.20	157 811 382.00
28.11.2018	25 108.32	160 507 290.00	14.11.2018	25 145.07	158 326 436.00	30.10.2018	24 668.43	150 699 122.00
27.11.2018	24 317.64	155 398 201.00	13.11.2018	25 169.68	158 857 560.00	29.10.2018	24 154.80	149 476 438.00
26.11.2018	24 014.93	152 446 505.00	12.11.2018	24 785.66	155 859 066.00	26.10.2018	24 772.87	154 749 166.00
23.11.2018	23 433.25	148 753 971.00	09.11.2018	25 327.42	159 220 248.00	25.10.2018	25 116.31	157 828 249.00
22.11.2018	23 490.25	149 115 728.00	08.11.2018	25 810.68	161 329 655.00	24.10.2018	24 154.33	151 783 269.00

СТОИМОСТЬ ИЗМЕНЕНИЯ ЦЕНЫ ПИФА:

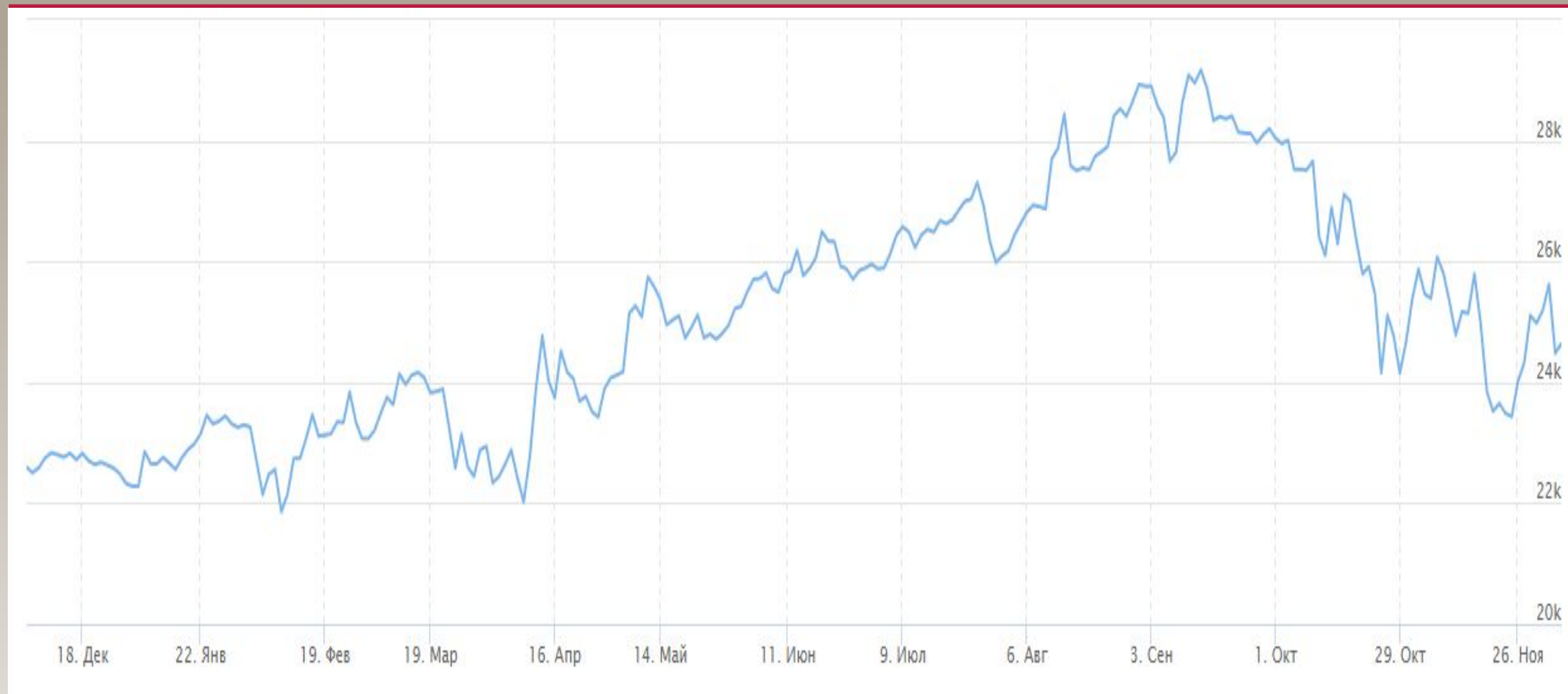
Минимальная сумма инвестирования

- Первоначальный взнос: 1 000 RUB
- Последующий взнос: 1 000 RUB

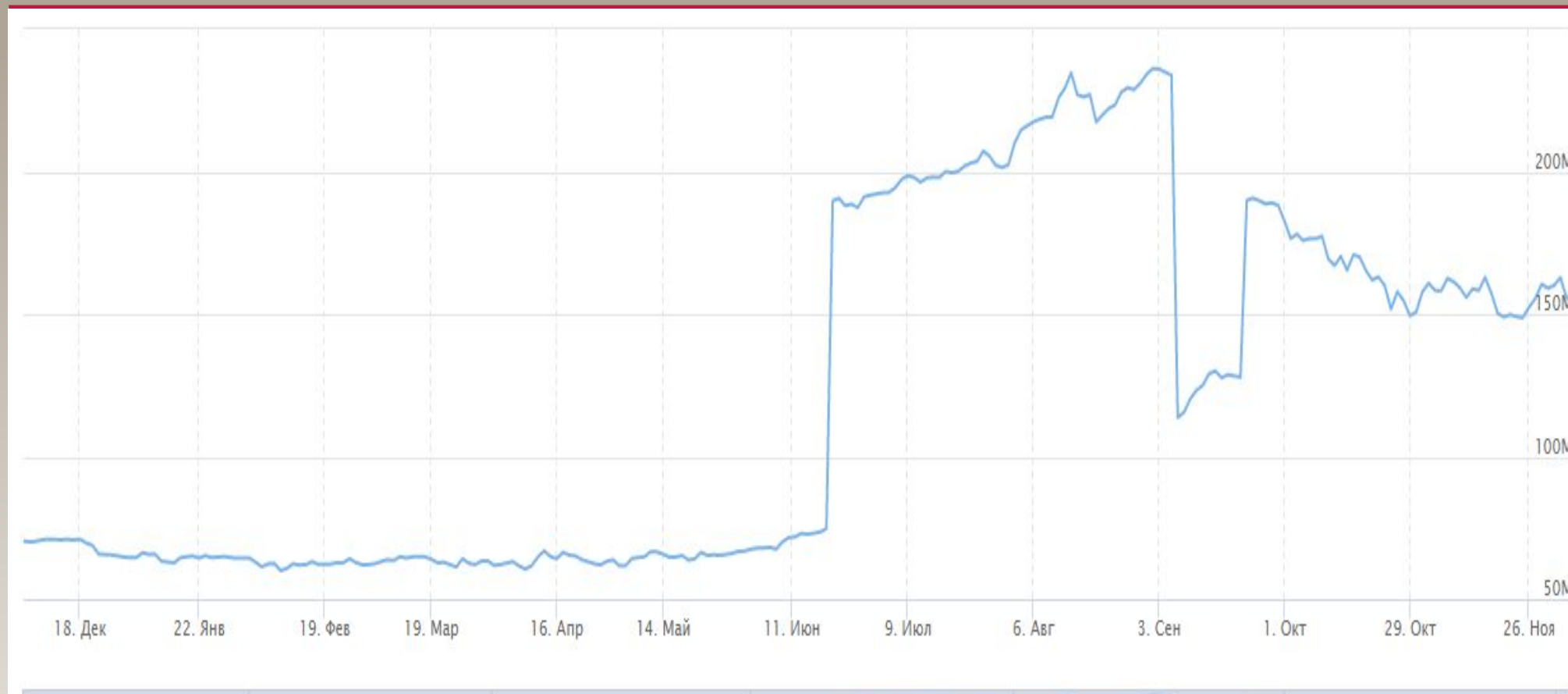
Инфраструктурные расходы

- Вознаграждение УК: 2.5%
- Вознаграждение депозитарию и др.: 0.6% с учетом НДС
- Прочие расходы: 2% с учетом НДС

ДИНАМИКА СТОИМОСТИ ПАЯ



ДИНАМИКА СТОИМОСТИ СЧА



ВЫВОД:

Цель инвестирования: Получение максимальной прибыли от роста инфраструктурных инвестиций в российской экономике и реализации долгосрочного потенциала развития информационных технологий и телекоммуникаций в России. Отличные перспективы развития бизнеса позволяют предполагать, что акции инфраструктурных компаний, операторов сектора связи и индустрии информационных технологий в долгосрочном периоде могут принести доход, значительно превосходящий среднерыночные показатели.