



Обзор по ОПИФ рфи «Алгоритмический» за ноябрь 2022

Открытый паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «Алгоритмический»

Дата составления : 02.12.2022

Структура портфеля

Структура активов	Доля
ОБЛИГАЦИИ Корпоративные	65,5%
ОБЛИГАЦИИ Государственные	0,0%
АКЦИИ Российские	28,1%
СРОЧНЫЙ рынок *	3,4%
СРОЧНЫЙ рынок (ОЧП)**	12,0%
ДЕНЕЖНЫЕ Средства (брокер), руб	2,6%
ДЕНЕЖНЫЕ Средства (банк), руб	0,4%
ДЕНЕЖНЫЕ Средства (банк), долл	0,0%
Итого	100,0%

* чистая направленная длинная позиция во фьючерсе МХ-09-22

Корпоративные облигации

Наименование	Доля	Доходность
АБЗ-1 1P01	1,9%	16,6%
АВТОДОМ 1P1	1,9%	16,6%
Аквилон1P1	2,5%	18,4%
АПРИФП БП4	2,6%	21,1%
АТОМ БП01	0,8%	12,9%
БифТек Р1	1,4%	14,9%
Боржоми 1P10	2,5%	19,7%
ВитаЛ 1P2	0,8%	13,1%
ГарИнв1P05	1,6%	16,2%
Дельта 1P01	1,7%	18,6%
Джи-гр 2P1	1,8%	15,8%
Инкаб5001	1,5%	16,4%
ЗаводКЭС 1P	1,7%	17,6%
ЛайфСтр П1	1,0%	14,5%
Левенгук Б1	1,3%	14,3%
ЛЕГЕНДА1P4	2,1%	24,7%
ЛТрейд 1P1	0,5%	13,0%
ЛТрейд1P2 (2024)	2,4%	20,5%
Ника 1P1	2,0%	17,0%
Окта Гр БП02	1,1%	13,9%
Пионер 1P5	1,7%	18,6%
Пионер 1P6	1,2%	18,5%
ПионерЛизБП4	1,7%	21,1%
ПКБ 1P-01	0,7%	12,2%
Победа 1P1	1,4%	16,6%
ПР-Лиз 2P1	1,1%	12,8%
Рейннол 1P1	2,0%	18,4%
реСтор Б1P1	2,6%	19,2%
РитейлБФ01	1,6%	13,1%
Самолет Р11	0,9%	13,0%
Самолет Р12	0,6%	13,1%
СлавЭко 1P1	0,7%	16,3%
ТехноЛиз 1P3	1,7%	15,3%
ТехноЛиз 1P4	1,5%	20,4%
ТрансФ1P07	1,4%	17,0%
ХайТэк 01	2,6%	23,1%
ХКФБанк Б06	1,4%	9,7%
ХэндрснБ01	1,0%	16,9%
Шевченко 1P4	1,7%	17,2%
Шевченко 1P3	2,6%	17,2%
ЭНИКА 1P02	2,4%	18,5%
Итого	65,5%	17,5%

Название фонда	Алгоритмический
№ и дата рег. ПДУ	№ 3374 от 22.08.2017 г.
Управляющая компания	ООО «УК «РЕКОРД КАПИТАЛ»
Порог входа	10 000 рублей – для лиц, не являющихся владельцами инвестиционных паев Фонда; 5 000 рублей – для владельцев инвестиционных паев Фонда.
Вознаграждение УК	2 % среднегодовой СЧА
Надбавка при выдаче паев	Нет
Скидка при погашении паев	Да***
Промежуточный доход	Нет
Тип клиентов	Неквал. инвесторы
Срок инвестирования	До 2032 года

Плановая структура активов фонда

Стратегия фонда предполагает размещение средств в следующие классы активов:
до 70% высокодоходные корп. облигации
до 25% акции роста
до 5% гарантийное обеспечение на срочном рынке под позиции во фьючерсах на индекс Московской Биржи, Индекс РТС, либо товарные активы и драгоценные металлы.
Совокупная длинная позиция может достигать до 20% СЧА.

Акции

Наименование	Доля
ДВМП ао	2,6%
Лукойл	4,6%
МТС	2,6%
НОВАТЭК	2,2%
ПОЛЮС-З	2,8%
САМОЛЕТ	4,2%
Сбербанк	3,7%
Яндекс	2,5%
МКБ	1,5%
ФосАгро	1,4%
Итого	28,1%

Комментарий Управляющего

Цена пая за ноябрь увеличилась на 2%! Индикатор бенчмарка за аналогичный период изменился на 0,12%, Индекс акций ММВБ вырос на 0,01%! Структура активов фонда претерпела некоторые изменения. Доля облигаций составила 65,5%, доля акций 28,1%.

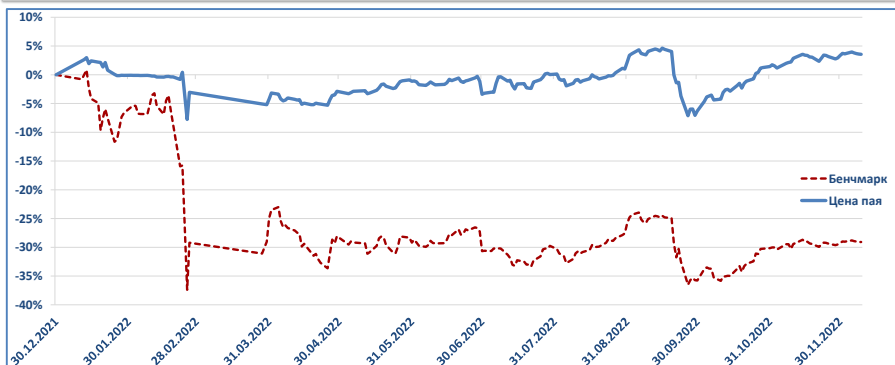
Наиболее интересные сделки в ноябре прошли в акциях Бурятзолото и Русолово! Позиция по акциям Бурятзолото была закрыта с доходом 29,8%, а позиция по акциям Русолово была закрыта с доходностью 32,16%.

На срочном рынке позиция сформирована во фьючерсе на юань, который за ноябрь вырос на 1,48%!

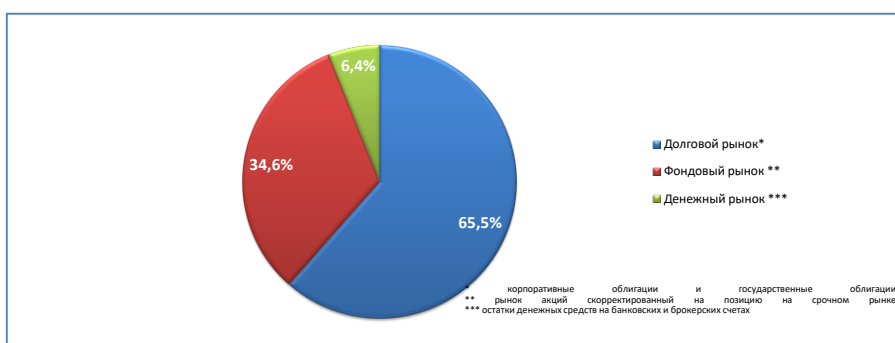
В случае отсутствия ярко выраженных негативных новостей вокруг геополитики, ожидаем спокойное закрытие года в виде плавного роста по основным индексам!

СЧА	23 648 658,44	
Цена пая на:	30.11.22	1 078,6
Цена пая на:	30.12.2021	1 043,7
Результат с Н.Г.:	3,3%	

Динамика изменения стоимости пая



Структура портфеля Фонда



* Подробные условия указаны в правилах доверительного управления паевым инвестиционным фондом.

** Стоимость инвестиционных паев может увеличиваться и уменьшаться, результаты инвестирования в прошлом не определяют доходы в будущем, государство не гарантирует доходность инвестиций в инвестиционные фонды. Прежде чем приобрести инвестиционный пай, следует внимательно ознакомиться с правилами доверительного управления паевым инвестиционным фондом

ООО «УК РЕКОРД КАПИТАЛ» Лицензия ЦБ РФ на осуществление деятельности по доверительному управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами и негосударственными пенсионными фондами № 21-000-1-00955 от 14 мая 2013г. Не осуществляет совмещение деятельности с деятельностью по управлению ценными бумагами и другими лицензируемыми видами деятельности. Стоимости инвестиционных паев увеличиваются, так и уменьшаются. Результаты инвестирования в прошлом не определяют доходы в будущем. Доходность инвестиций в паевой инвестиционный фонд не гарантируется государством. Перед приобретением инвестиционных паев необходимо внимательно ознакомиться с правилами доверительного управления паевым инвестиционным фондом. Получить информацию о фонде и ознакомиться с Правилами доверительного управления фондом, иными документами, предусмотренными Федеральным законом «Об инвестиционных фондах» и нормативными актами в сфере финансовых рынков, можно по адресу ООО «УК «РЕКОРД КАПИТАЛ»: 630099, Россия, г. Новосибирск, ул. Чаллыгина, д. 47, пом. 2,3,4,5,6,7. Телефон: (383) 207-54-23. Адрес в сети интернет: <https://recordcap.ru/component/fund/fund2>



Важная информация

Доход по инвестиционным паям подлежит налогообложению. Налоговый агент по НДФЛ – управляющая компания. Правила доверительного управления № 3374 зарегистрированы Банком России 22.08.2017 г. (далее также «Правила Фонда»). ОБЩЕСТВО С ОГРАНИЧЕННОЙ ОТВЕТСТВЕННОСТЬЮ «УПРАВЛЯЮЩАЯ КОМПАНИЯ «РЕКОРД КАПИТАЛ». Лицензия на осуществление деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами и негосударственными пенсионными фондами № 21-000-1-00955 от 14.05.2013г. выдана Центральным Банком РФ, без ограничения срока действия. Правилами доверительного управления паевыми инвестиционными фондами, находящимися под управлением ООО «УК «РЕКОРД КАПИТАЛ», предусмотрены надбавки к расчетной стоимости инвестиционных паев при их выдаче и скидки к расчетной стоимости паев при их погашении. Обращаем Ваше внимание на то, что взимание скидок и надбавок уменьшает доходность инвестиций в инвестиционные паи паевых инвестиционных фондов. При определении прироста расчетной стоимости инвестиционного пая не учитываются надбавки к расчетной стоимости инвестиционных паев при их выдаче и скидки к расчетной стоимости инвестиционных паев при их погашении. Стоимость инвестиционных паев может увеличиваться и уменьшаться, результаты инвестирования в прошлом не определяют доходы в будущем, государство не гарантирует доходность инвестиций в инвестиционные фонды. Прежде чем приобрести инвестиционный пай, следует внимательно ознакомиться с правилами доверительного управления паевыми инвестиционными фондами. Подробную информацию о деятельности ООО «УК «РЕКОРД КАПИТАЛ» и паевых инвестиционных фондов, находящихся под ее управлением, включая тексты правил доверительного управления, всех изменений и дополнений к ним, а также сведения о местах приема заявок на приобретение, погашение и обмен инвестиционных паев Вы можете получить по адресу: г. Новосибирск, ул. Дуси Ковальчук, 260/2 цокольный этаж, а также г. Санкт-Петербург, Большой проспект П.С., д. 18 Литера А, офис: 214. Телефоны: (383) 207-54-23, 8 (800) 707-04-78, а также на сайте ООО «УК «РЕКОРД КАПИТАЛ» в сети Internet по адресу: www.recordcap.ru. Не является индивидуальной инвестиционной рекомендацией. Атрибуты инвестиционной стратегии означают целевые показатели портфеля фонда, к которым будет стремиться управляющий, чтобы реализовать инвестиционную цель фонда, но изменяемые по усмотрению управляющего, если того требуют интересы клиентов.

При подаче заявки на погашение инвестиционных паев Фонда Управляющей компании скидка, на которую уменьшается расчетная стоимость инвестиционного пая, составляет:
0,5% (ноль целых пять десятых процента) от расчетной стоимости инвестиционного пая, в случае если заявка на погашение инвестиционных паев подана до истечения 365 (трехсот шестидесяти пяти) дней со дня внесения приходной записи по зачислению данных инвестиционных паев на лицевой счет владельца инвестиционных паев, открытый в реестре владельцев инвестиционных паев;

0,25 % (ноль целых двадцать пять сотых процента) от расчетной стоимости инвестиционного пая, в случае если заявка на погашение инвестиционных паев подана после истечения 365 (трехсот шестидесяти пяти) дней со дня внесения приходной записи по зачислению данных инвестиционных паев на лицевой счет владельца инвестиционных паев, открытый в реестре владельцев инвестиционных паев.

При подаче заявки на погашение инвестиционных паев Фонда Агенту АО «Специализированный депозитарий «ИНФИНИТУМ» в виде электронного документа посредством информационного сервиса Агента АО «Специализированный депозитарий «ИНФИНИТУМ» «Финансовая платформа», скидка, на которую уменьшается расчетная стоимость инвестиционного пая, составляет:

2,5% (два процента) от расчетной стоимости инвестиционного пая, в случае если заявка на погашение инвестиционных паев подана до истечения 182 (ста восьмидесяти двух) дней со дня внесения приходной записи по зачислению данных инвестиционных паев на лицевой счет владельца инвестиционных паев, открытый в реестре владельцев инвестиционных паев;

1,5% (один процент) от расчетной стоимости инвестиционного пая, в случае если заявка на погашение инвестиционных паев подана после истечения 182 (ста восьмидесяти двух) дней и до истечения 365 (трехсот шестидесяти пяти) дней со дня внесения приходной записи по зачислению данных инвестиционных паев на лицевой счет владельца инвестиционных паев, открытый в реестре владельцев инвестиционных паев;

0,5 % (ноль процентов) от расчетной стоимости инвестиционного пая, в случае если заявка на погашение инвестиционных паев подана после истечения 365 (трехсот шестидесяти пяти) дней со дня внесения приходной записи по зачислению данных инвестиционных паев на лицевой счет владельца инвестиционных паев, открытый в реестре владельцев инвестиционных паев.

Скидка не взимается в случае подачи заявки на погашение инвестиционных паев номинальным держателем или доверительным управляющим.

