



Обзор по ОПИФ рфи «Алгоритмический» за декабрь 2022

Открытый паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «Алгоритмический»
 Правила доверительного управления фондом зарегистрированы Банком России «22» августа 2017г. №3374

Дата составления : 10.01.2023



Структура портфеля

Структура активов	Доля
ОБЛИГАЦИИ Корпоративные	59,9%
ОБЛИГАЦИИ Государственные	9,7%
АКЦИИ Российские	24,8%
СРОЧНЫЙ рынок *	3,6%
СРОЧНЫЙ Рынок (ОЧП)**	18,3%
ДЕНЕЖНЫЕ Средства (брокер), руб	1,7%
ДЕНЕЖНЫЕ Средства (банк), руб	0,3%
ДЕНЕЖНЫЕ Средства (банк), долл	0,0%
Итого	100,0%

* чистая направленная длинная позиция во фьючерсе MX-09.22

Корпоративные облигации



Наименование	Доля	Доходность
АБЗ-1 1Р01	2,4%	14,3%
АВТОДОМ 1Р1	2,5%	16,8%
Аквилон1Р1	2,5%	17,0%
АПРИФП БП4	2,5%	19,0%
Боржон1Р10	2,6%	19,9%
ГарИнв1Р05	2,1%	14,6%
Дельта 1Р01	2,3%	16,1%
Джи-гр 2Р1	2,5%	16,5%
ИйнкаБ001	2,4%	21,1%
Левенгук Б1	1,6%	14,3%
ЛЕГЕНДА1Р4	2,4%	26,5%
ЛТрейд1Р2 (2024)	2,5%	18,2%
Ника 1Р1	2,4%	1,9%
Пионер 1Р5	2,4%	17,3%
ПионерЛизБП4	2,5%	17,6%
Победа 1Р1	2,1%	15,7%
Рейнгол 1Р1	2,4%	17,8%
реСтор Б1Р1	2,5%	17,1%
СлавЭко 1Р1	2,4%	16,2%
ТехноЛИЗ 1Р4	2,5%	20,6%
ТрансФ1Р07	2,2%	16,3%
ХайТак 01	2,5%	17,7%
ХэндрснБ01	2,4%	15,0%
Шевченко 1Р3	2,6%	16,3%
ЭНИКА 1Р02	2,5%	18,3%
Итого	59,9%	17,6%

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	2,5%
Лукойл	2,5%
НОВАТЭК	2,5%
ПОЛЮС-З	2,5%
Сургут-преф	2,5%
Сбербанк	2,5%
МКБ	2,5%
ФосАгро	2,5%
Роснефть	2,5%
МТС	2,5%
Итого	24,8%



Комментарий Управляющего

По итогам декабря цена пая выросла на 2,9%! В целом итоги 2022 года в динамике стоимости пая составили +6,3%! Фондовый рынок по индексу ММВБ упал на 43,1%! Расчетный бенчмарк фонда снизился на 22,7%! По эффективности инвестиций команда управляющих в текущем году существенно обошла и рынок, и бенчмарк! Если проанализировать динамику пая внутри года, то заметен поступательный плавный рост и два резких снижения: первое из них в момент начала СВО, второй в момент объявления мобилизации в России. Падение цены пая в самый критический момент составила в среднем 10%, что в принципе является "рабочей" волатильностью любого финансового инструмента.

По итогу года портфель на 60% состоял из корпоративных облигаций высокодоходного сектора, 25% акций российских компаний и почти 20% открытая длинная позиция во валютных фьючерсах на доллар и юань! Среди российских акций выделены компании ориентированные и на внутренний рынок, такие как СБЕР, МКБ, МТС, ДВМП, среди нефтегазовых экспортеров мы выделяем Новатэк, Лукойл, Роснефть, Сурпреф, также отмечаем перспективы Полусозолота в связи с вектором увеличения доли золота в резервах мировых ЦБ!

В 2023 году мы ожидаем продолжения высокой волатильности на рынке. Устойчивого роста в условиях высоких геополитических рисков ожидать не стоит. Экономике страны ждет постепенная структурная перестройка, будут появляться новые лидеры, кто-то будет вынужден уйти с рынка. Продолжаем следить за трендами и сохранять гибкость в принятии решений!

Открытые позиции на срочном рынке

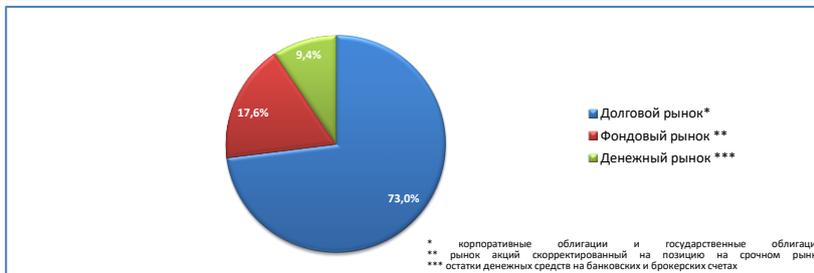
СЧА	24 650 036,77	
Цена пая на:	30.12.22	1 109,8
Цена пая на:	30.12.2021	1 043,7
Результат 2022 г.:	6,3%	

Наименование	Доля к Активам
СРНЗ	8,67%
СНЗ	9,66%

Динамика изменения стоимости пая



Структура портфеля Фонда



* корпоративные облигации и государственные облигации
 ** рынок акций скорректированный на позицию на срочном рынке
 *** остатки денежных средств на банковских и брокерских счетах

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

**СТОИМОСТЬ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ПАЕВ МОЖЕТ УВЕЛИЧИВАТЬСЯ И УМЕНЬШАТЬСЯ, РЕЗУЛЬТАТЫ ИНВЕСТИРОВАНИЯ В ПРОШЛОМ НЕ ОПРЕДЕЛЯЮТ ДОХОДЫ ВБУДУЩЕМ, ГОСУДАРСТВО НЕ ГАРАНТИРУЕТ ДОХОДНОСТЬ ИНВЕСТИЦИЙ В ИНВЕСТИЦИОННЫЕ ФОНДЫ. ПРЕЖДЕ ЧЕМ ПРИОБРЕСТИ ИНВЕСТИЦИОННЫЙ ПАЙ, СЛЕДУЕТ ВНИМАТЕЛЬНО ОЗНАКОМИТЬСЯ С ПРАВИЛАМИ ДОВЕРИТЕЛЬНОГО УПРАВЛЕНИЯ ПАЕВЫМ ИНВЕСТИЦИОННЫМ ФОНДОМ



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 паевым инвестиционным фондом. 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. Дуся 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.