



Обзор по ОПИФ рфи «Алгоритмический» за февраль 2023

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

Дата составления : 02.03.2023

Структура портфеля

Структура активов	Доля
ОБЛИГАЦИИ Корпоративные	68,0%
ОБЛИГАЦИИ Государственные	6,5%
АКЦИИ Российские	20,2%
СРОЧНЫЙ рынок (ГО) **	4,3%
СРОЧНЫЙ Рынок (ОЧП) **	9,8%
ДЕНЕЖНЫЕ Средства (брокер), руб	0,1%
ДЕНЕЖНЫЕ Средства (банк), руб	0,9%
ДЕНЕЖНЫЕ Средства (банк), долл	0,0%
Итого	100,0%

* чистая направленная длинная позиция во фьючерсе MX-09.22

Корпоративные облигации

Наименование	Доля	Доходность
АБЗ О1РЗ	2,6%	15,0%
АВТОЛОМ	2,6%	14,2%
Аквилон/Р1	2,8%	15,7%
АПРИФ БП4	2,5%	18,8%
Боржоми	2,7%	15,2%
Дельта 1Р01	2,7%	16,1%
Джи-гр 2Р1	2,6%	15,7%
ЕвроТранс 1Р2	2,7%	14,2%
ИнкаБ001	2,4%	16,8%
ЛЕГЕНДА1Р4	2,4%	16,5%
Лтрейд 2	2,7%	17,1%
Мотор1Р03	2,7%	16,7%
Ника 1Р1	2,2%	17,8%
Пионер 1Р5	2,5%	15,9%
ПионерЛизБП4	2,6%	17,6%
Победа 1Р1	2,4%	15,5%
РегПрод Р2	2,2%	16,1%
Рейнгол 1Р1	2,3%	17,0%
реСтар Б1Р1	2,3%	16,0%
Родлен 1Р4	2,7%	14,9%
РоялКап 607	2,6%	15,3%
СлавЭко 1Р1	2,4%	16,3%
ТехноЛИЗ 1Р4	2,4%	18,5%
ТрансФ1Р07	2,5%	15,9%
ХайТэк 01	2,4%	11,8%
Шевченко 1Р4	2,7%	14,5%
ЭНИКА 1Р02	2,4%	17,1%
Итого	68,0%	16,0%

Государственные облигации

Наименование	Доля
ОФЗ 26223	6,53%

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	2,6%
Самолет	2,5%
OZON	2,6%
Русолово	2,4%
ПОЛЮС з	2,5%
Сбербанк	2,6%
Роснефть	2,5%
Мосбиржа	2,5%
Итого	20,2%

СЧА	11 517 772,23
Цена пая на:	28.02.23 1 157,7
Цена пая на:	30.12.2022 1 109,8
Результат с Н.Г.:	4,3%

Открытые позиции на срочном рынке

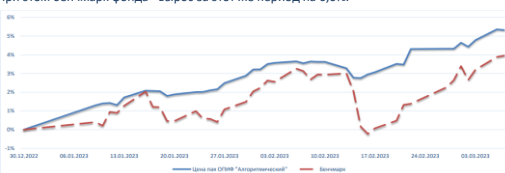
Наименование	Доля к Активам
МХНЗ	9,81%

Комментарий Управляющего

Динамика фондового рынка за февраль составила скромный прирост в пределах 1% по индексу Московской биржи. В первой декаде февраля рынок уверенно закрепился выше ноябрьских максимумов на уровне 2250 пунктов. Однако во второй половине месяца произошла заметная коррекция, как обычно в последнее время под влиянием геополитических обострений, в частности усиления риторики накануне годовщины начала СВО. Но уже концу месяца рынок восстановился от негативной динамики



Что касается динамики стоимости пая фонд, то прирост пая был более уверенным и почти без заметной коррекции. По итогам месяца стоимости пая выросла почти на 1,1%! При этом бенчмарк фонда* вырос за этот же период на 0,6%.



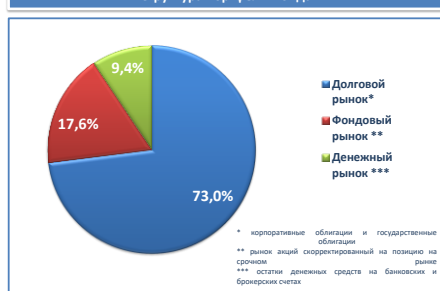
Что касается структуры фонда, то она претерпела ряд изменений: доля российских акций снизилась до 20%, доля корпоративных облигаций составила 68%, доля ликвидных и высоконадежных денежных средств (остатки на счетах и офз) составила около 12%. Стоит обратить внимание на устойчивость фонда на данном отрезке времени, в течении февраля максимальное снижение по индексу Московской биржи было в пределах -6,3%, Бенчмарк фонда снижался чуть более 3%, а стоимость пая корректировалась менее чем на 1%! При этом доходность фонда опередила показатели индекса и бенчмарка, что говорит о заметном преимуществе стратегии фонда по показателю Доходность/Риск!

*Синтетический расчетный индекс, который формируется на основе индексов, рассчитываемых Московской Биржей. Расчет СРИ осуществляется по формуле $(RUCBTRSTY * 0,70 + IMOEX * 0,30)$, где RUCBTRSTY – индекс корпоративных облигаций 3-5 лет, а IMOEX – индекс акций.

Динамика изменения стоимости пая



Структура портфеля Фонда



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

Структура портфеля облигаций по отраслям



* 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. Стоимость инвестиционного пая увеличивается, так и уменьшается. 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» г.630099, Россия, г. Новосибирск, ул. Чаплыгина, д. 47, пом. 2,3,4,5,6,7. Телефон: (383) 207-54-23. Адрес в сети интернет: <https://recordcap.ru/component/fund/fund/2>





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. 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.