



Обзор по ОПИФ рфи «Алгоритмический» за май 2023

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

Дата составления : 05.06.2023

Структура портфеля

Структура активов	Доля
ОБЛИГАЦИИ Корпоративные	26,7%
ОБЛИГАЦИИ Государственные	54,6%
АКЦИИ Российские	5,0%
СРОЧНЫЙ рынок (ГО) *	3,8%
СРОЧНЫЙ Рынок (СЧП)**	12,8%
ДЕНЕЖНЫЕ Средства (брокер), руб	4,4%
ДЕНЕЖНЫЕ Средства (банк), руб	5,9%
ДЕНЕЖНЫЕ Средства (банк), долл	0,0%
Итого	100%

* чистая направленная длинная позиция во фьючерсе MX-09.22

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.

СЧА	4 159 920,54	
Цена пая на:	31.05.23	1 208,1
Цена пая на :	30.12.2022	1 109,8
Результат с Н.Г. :	8,9%	

Сравнение динамики пая и бенчмарка

	По итогам месяца	С Н.Г.
Изменение пая	1,31%	8,86%
Изменения Бенчмарка	2,10%	9,50%

Акции

Наименование	Доля
ПАО "МКБ"	2,5%
ПАО "Самолет"	2,5%
Итого	5,0%

Комментарий Управляющего

По итогам мая пай фонда вырос на 1,3% пункта. Бенчмарк фонда за аналогичный период вырос на 2,1% пункт. Основной причиной отставания на локальном участке от бенчмарка является более низкая доля рискованных инструментов, в первую очередь акций, в связи с повышенными геополитическими рисками. В целом с начала года пай фонда показывает прирост почти на 9%, при росте бенчмарка на 9,5%!

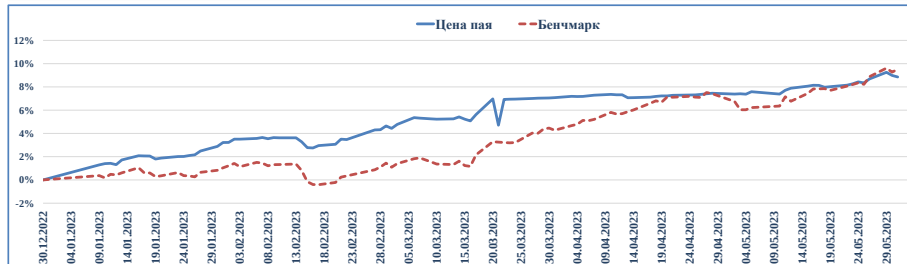
Рынок в мае преимущественно показывал не устойчивую динамику. В начале месяца наблюдалось снижение рынка, многие участники сокращали позиции в период длинных праздников на ожидании обострения боевых действий в районах проведения СВО. К середине месяца, рынок восстановил потери в условиях отсутствия негативных факторов. К концу месяца рынок вернулся к росту.



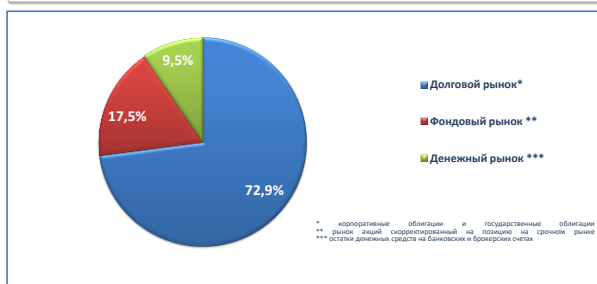
В течении мая в структуре фонда удерживали позицию во фьючерсе на рубль / доллар. Среди акций в портфель включены акции Самолет и МКБ.

В дальнейшем при закреплении индекса Московской Биржи выше уровня 2690 пунктов планируем восстановить долю акций (рисковых активов) к плановому targetу до 25% от СЧА.

Динамика изменения стоимости пая

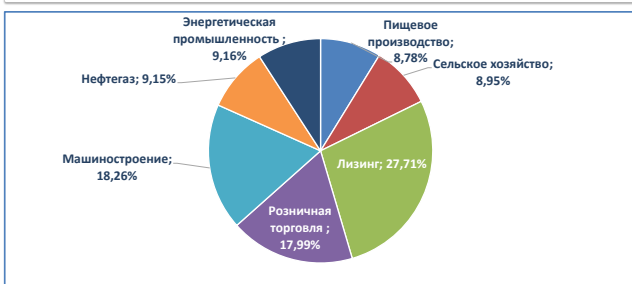


Структура портфеля Фонда



* корпоративные облигации и государственные облигации
** рынок акций - сосредоточенный на позиции на срочном рынке
*** 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»»: 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 пай 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. Чаплыгина, д. 47, 2 этаж. 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.