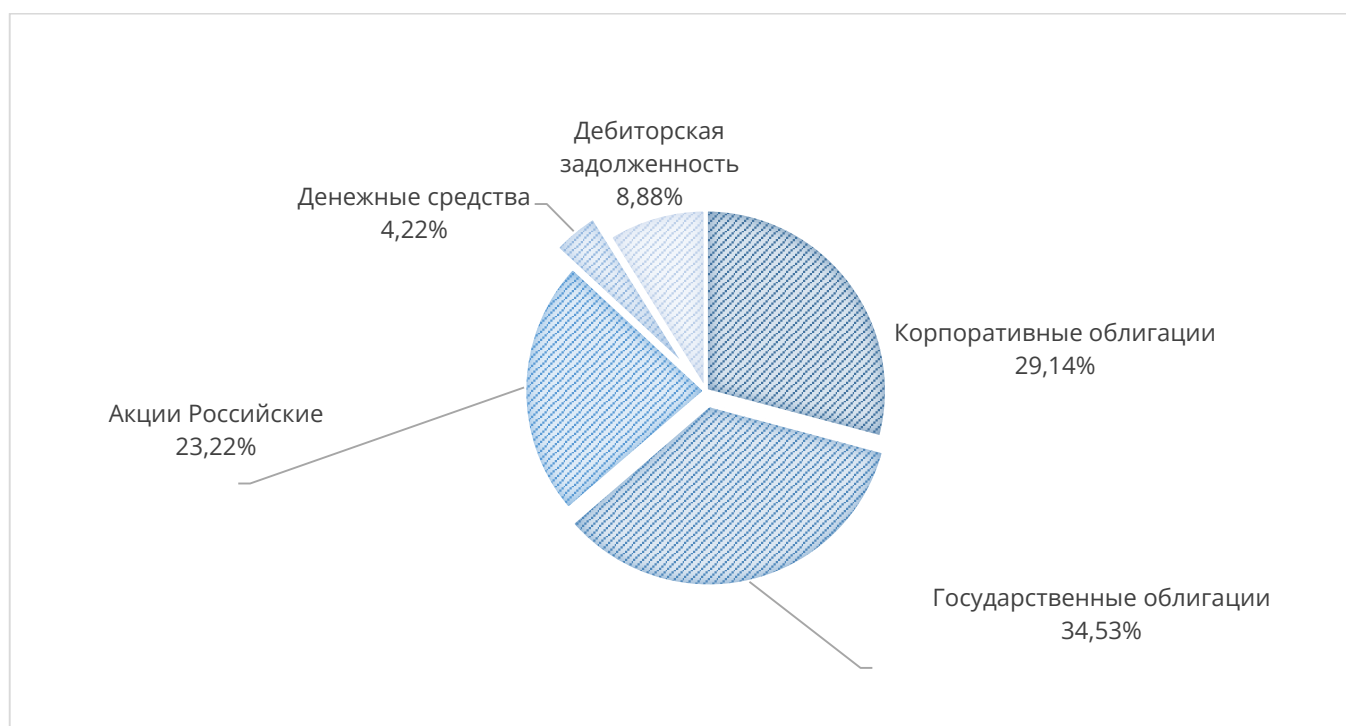


Обзор по Открытому паевому инвестиционному фонду рыночных финансовых инструментов «Алгоритмический» за февраль 2024

Правила доверительного управления фондом зарегистрированы Банком России
22 августа 2017 г. №3374

Структура портфеля



Комментарии управляющего

Существенных изменений за февраль в структуре активов фонда не происходило. Стоит отметить фактор ОФЗ, оказывающих в данный момент наибольшее негативное влияние на динамику стоимости пая. В структуре долговых инструментов фонда значительную часть, а именно почти 35%, занимают долгосрочные облигации федерального займа.

По итогам прошедшего в феврале заседания Банка России и опубликованных комментариев рынок расценил негативно жесткую риторику. Центральным банком была в очередной раз продемонстрирована приверженность к удержанию высокого уровня ставок. Прогноз на снижение ставок во втором полугодии 2024 года имеет место, но может быть, как скорректирован, в случае инфляционного давления, так и отложен на неопределенный срок.

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

ОФЗ 26238 График цены и объема (60 минут)



Все эти факторы крайне негативно повлияли на длинные выпуски облигаций. В частности, ОФЗ 26238 с погашением в 2041 году подешевела по курсу почти на 3,5%. Падение продолжилось и в первой половине марта. К настоящему моменту (по итогам торгов 7 марта 2024 года) курс облигаций снизился с начала 2024 года уже на 6%.

Хотя долгосрочным инвесторам данный момент времени дает отличную возможность сформировать выгодные торговые позиции. Так или иначе ставка ЦБ на уровне выше 15% годовых считается «ограничительной» и будет стремиться к снижению. Консенсус – прогноз на рынке: ключевая ставка к концу 2024 года может составить в диапазоне 11-13% годовых. Это неминуемо позитивно скажется на восстановлении курса долгосрочных облигаций.

Акции российские по эмитентам

ПАО "ПИК-СЗ"	2,41%
ПАО "МКБ"	2,36%
ПАО "Татнефть"	2,35%

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

ПАО "Группа компаний "Самолет"	2,32%
ПАО "НК "ЛУКОЙЛ"	2,34%
ПАО "Сбербанк России"	2,24%
ПАО "НК "Роснефть"	2,27%
ПАО "НОВАТЭК"	2,20%
ПАО "Полюс"	2,25%
ПАО "Сургутнефтегаз"	2,48%

Корпоративные облигации

ООО "Роял Капитал"	2,27%
ООО "НИКА"	2,00%
ООО "Реиннольц"	2,37%
ООО "ЭНЕРГОНИКА"	2,26%
ООО "Аквилон-Лизинг"	1,73%
ООО "реСтор"	2,31%
ООО "ЛЕГЕНДА"	2,32%
ООО "Инкаб"	2,30%
ООО "Славянск ЭКО"	2,32%
ООО НПП "Моторные технологии"	2,30%
АО "РЕГИОН-ПРОДУКТ"	2,31%
ООО "Лизинг-Трейд"	2,29%

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

АО "КИФА"

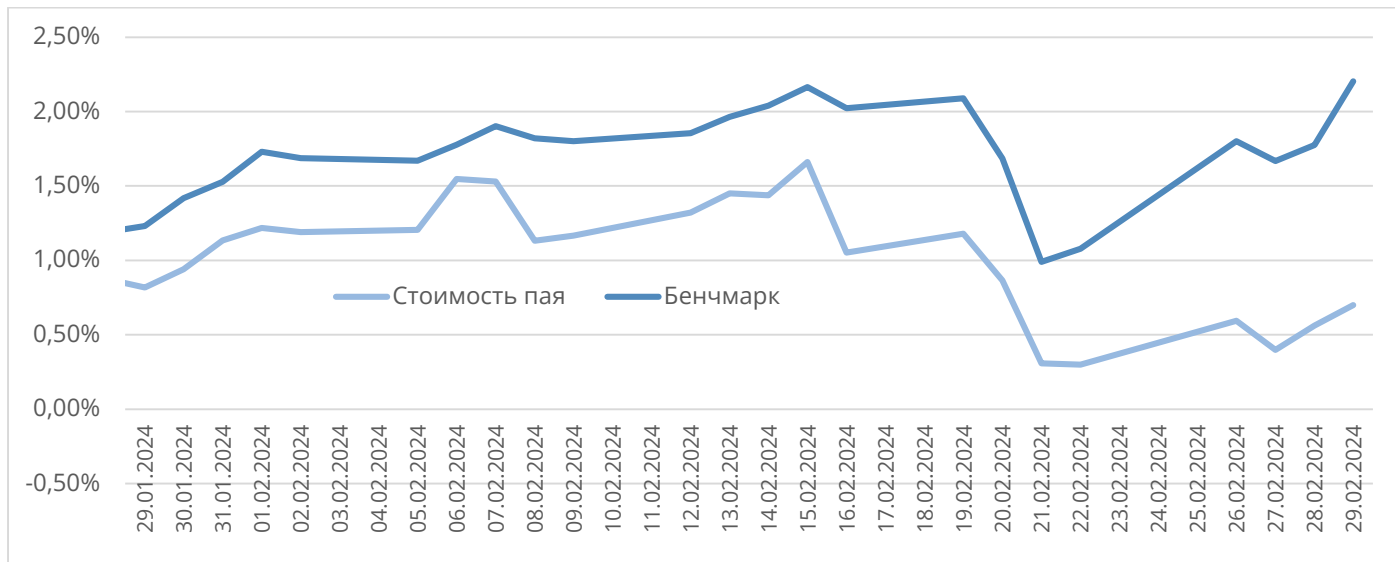
2,34%

Государственные облигации

Министерство финансов Российской Федерации

34,53%

Динамика изменения стоимости пая и бенчмарка



Стоимость чистых активов	Стоимость пая	Доходность					
		за 1 месяц	за 3 месяца	за 6 месяцев	за 1 год	за 3 года	за 5 лет
на 29.02.2024							
9 768 954,97	1 244,38	- 0,40%	+ 0,65%	- 0,08%	+ 7,52%	+ 14,97%	+ 8,17%

Правилами доверительного управления фондом предусмотрены скидки с расчетной стоимости инвестиционных паев при их погашении. Взимание скидок и надбавок уменьшает доходность инвестиций в инвестиционные паи.

Дата составления: 12.03.2024

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 2013 г. выдана ФСФР России. ОГРН 1137746080768.

Не осуществляет совмещение деятельности с деятельностью по управлению ценными бумагами и другими лицензируемыми видами деятельности.

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

Стоимость инвестиционного пая может как увеличиваться, так и уменьшаться. 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. Инвестирование в активы, предусмотренные в инвестиционной декларации паевого инвестиционного фонда, связано с определенной степенью рисков и не подразумевает гарантий, как по возврату основной инвестиционной суммы, так и по получению доходов. Получить информацию о фондах и ознакомиться с Правилами доверительного управления фондов, иными документами, предусмотренными Федеральным законом «Об инвестиционных фондах» и нормативными актами в сфере финансовых рынков, можно по адресу: ООО «УК «РЕКОРД КАПИТАЛ», 630099, НОВОСИБИРСКАЯ ОБЛАСТЬ, ГОРОДСКОЙ ОКРУГ ГОРОД НОВОСИБИРСК, Г НОВОСИБИРСК, УЛ ЧАПЛЫГИНА, Д. 47, ПОМЕЩ. 2, 3, 4, 5, 6, 7. Телефон: (383) 207-54-23. Режим работы: Пн - Пт с 9:00 до 18:00; Сб, Вс - выходные дни. Адрес в сети интернет: <https://recordcap.ru>

Членство в Национальной ассоциации участников фондового рынка (НАУФОР), <https://naufor.ru/>, с 04.12.2015г.

Адрес электронной почты ООО «УК «РЕКОРД КАПИТАЛ» - info@recordcap.ru.

Обращения в ООО «УК «РЕКОРД КАПИТАЛ» можно направлять по адресу: 630099, НОВОСИБИРСКАЯ ОБЛАСТЬ, ГОРОДСКОЙ ОКРУГ ГОРОД НОВОСИБИРСК, Г. НОВОСИБИРСК, УЛ ЧАПЛЫГИНА, Д. 47, ПОМЕЩ. 2, 3, 4, 5, 6, 7, либо по адресу эл. почты info@recordcap.ru.

Все споры и разногласия решаются путем переговоров, с соблюдением досудебного претензионного порядка урегулирования спора, а при недостижении согласия в соответствии с установленной законодательством Российской Федерации компетенцией судов передаются в суд согласно определенной в договоре подсудности.

Вы вправе обратиться с претензией в ООО "УК "РЕКОРД КАПИТАЛ" по адресу: 630099, НОВОСИБИРСКАЯ ОБЛАСТЬ, ГОРОДСКОЙ ОКРУГ ГОРОД НОВОСИБИРСК, Г НОВОСИБИРСК, УЛ ЧАПЛЫГИНА, Д. 47, ПОМЕЩ. 2, 3, 4, 5, 6, 7, либо по адресу эл. почты info@recordcap.ru

Вы вправе также обратиться в Банк России (<https://www.cbr.ru/Reception/>) или СРО НАУФОР (<https://naufor.ru/tree.asp?n=2277>).

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