

РЕЗУЛЬТАТЫ РАБОТЫ СТРАТЕГИЙ РОБОТА-СОВЕТНИКА

По состоянию на 09 Сентября

	Ультраконсервативный	Консервативный	Сбалансированный	Агрессивный	Ультраагрессивный	ИИ
С момента запуска						
Портфель, abs *	29,58%	41,13%	37,20%	43,23%	54,35%	-4,27%
Бенчмарк, abs *	26,65%	30,85%	34,40%	34,67%	32,39%	-5,84%
Alpha	2,93%	10,28%	2,80%	8,56%	21,96%	1,57%
С начала 2022 года						
Портфель, abs *	3,81%	-2,81%	-17,44%	-22,09%	-26,78%	-36,65%
Бенчмарк, abs *	5,75%	-2,22%	-14,18%	-22,15%	-34,10%	-34,65%
Alpha	-1,94%	-0,59%	-3,26%	0,06%	7,32%	-2,00%
С начала месяца						
Портфель, abs *	0,40%	0,53%	1,18%	1,32%	1,48%	0,08%
Бенчмарк, abs *	0,41%	0,49%	0,65%	0,78%	1,04%	1,08%
Alpha	-0,01%	0,04%	0,53%	0,54%	0,44%	-1,00%
За неделю						
Портфель, abs *	0,18%	-0,11%	-0,84%	-1,05%	-1,25%	-1,26%
Бенчмарк, abs *	0,23%	-0,03%	-0,51%	-0,91%	-1,67%	-1,84%
Alpha	-0,05%	-0,08%	-0,33%	-0,14%	0,42%	0,58%

СТРУКТУРА ПОРТФЕЛЯ

Name,	Ticker	Target Weight					Date of purchase inclusion	Current price	1 Week price change, % since inclusion	Price change	YTD price change, %	YTD TR, %	
		Ultra-conservative	Conservative	Balanced	Aggressive	Ultra-aggressive							
Equities		5,0%	38,7%	72,3%	85,7%	99,0%							
LUKOIL PJSC	LKOH RX Equity	0,0%	3,9%	7,8%	9,4%	10,9%	31.12.2021	6570,00	4 470,00	-2,72%	-31,96%	-30,82%	-30,82%
Sberbank of Russia PJSC	SBER RX Equity	0,0%	5,0%	10,0%	12,0%	14,0%	31.12.2021	293,62	138,15	-3,93%	-52,95%	-52,51%	-52,51%
Gazprom PJSC	GAZP RX Equity	0,0%	3,3%	6,7%	8,0%	9,3%	31.12.2021	343,28	245,34	-2,95%	-28,53%	-28,92%	-28,92%
MMC Norilsk Nickel PJSC	GMKN RX Equity	0,0%	2,1%	4,3%	5,1%	5,9%	31.12.2021	22828,00	16 740,00	-0,04%	-26,67%	-26,41%	-16,73%
Novatek PJSC	NVTK RX Equity	0,0%	2,5%	4,9%	5,9%	6,9%	31.12.2021	1720,00	1 160,00	0,97%	-32,56%	-32,16%	-29,21%
Magnit PJSC	MGNT RX Equity	0,0%	1,3%	2,6%	3,1%	3,6%	31.12.2021	5441,50	5 499,00	0,25%	1,06%	2,27%	2,27%
Polyus	PLZL RX Equity	0,0%	2,8%	5,6%	6,7%	7,8%	31.12.2021	13075,00	8 208,00	-2,03%	-37,22%	-36,71%	-36,71%
Rosneft	ROSN RX Equity	0,0%	1,5%	3,1%	3,7%	4,3%	31.12.2021	599,90	378,00	-1,84%	-36,99%	-36,25%	-31,96%
Tatneft	TATN RX Equity	0,0%	2,8%	5,6%	6,7%	7,8%	31.12.2021	500,50	441,80	-2,02%	-11,73%	-11,27%	-5,89%
PhosAgro	PHOR RX Equity	0,0%	2,8%	5,6%	6,7%	7,8%	31.12.2021	5833,00	7 770,00	-2,74%	33,21%	35,13%	35,13%
PIKK	PIKK RX Equity	0,0%	2,8%	5,6%	6,7%	7,8%	31.12.2021	1110,00	767,80	-0,03%	-30,83%	-28,57%	-28,57%
Alrosa	ALRS RX Equity	0,0%	2,8%	5,6%	6,7%	7,8%	31.12.2021	122,80	75,19	1,31%	-38,77%	-38,42%	-38,42%
VTB - Gold Fund Exchange	VTBG RX Equity	5,0%	5,0%	5,0%	5,0%	5,0%	31.12.2021	1,10	#N/A N/A	#VALUE!	#VALUE!	#VALUE!	#VALUE!
Bonds	ID_ISIN	94,0%	60,3%	26,7%	13,3%	0,0%							
RFLB 7.4 07/17/24	RU000A1007F4	6,8%	4,4%	1,9%	1,0%	0,0%			99,55	0,05%		1,56%	1,65%
RFLB 4 1/2 07/16/25	RU000A101QE0	6,8%	4,4%	1,9%	1,0%	0,0%			91,90	0,13%		3,52%	3,77%
RFLB 7.65 04/10/30	RU000A100A82	6,8%	4,4%	1,9%	1,0%	0,0%			94,65	-0,05%		-1,75%	0,66%
RFLB 7.15 11/12/25	RU000A100EG3	6,8%	4,4%	1,9%	1,0%	0,0%			98,29	0,09%		2,05%	4,76%
RFLB 8 1/2 09/17/31	RU000A0JVV48	6,8%	4,4%	1,9%	1,0%	0,0%			99,50	-0,30%		-2,21%	0,68%
VTBB ETF Corp Bonds													
Smart Beta	RU000A1002S8	40,0%	25,7%	11,3%	5,7%	0,0%			#N/A N/A	#VALUE!		#VALUE!	#VALUE!
Ingosstrakh Russian Corporate	RU000A103CA4	10,0%	6,4%	2,8%	1,4%	0,0%			108,55	0,81%		7,04%	7,39%
INFL ETF Ingosstrakh Inflation	RU000A1047H6	10,0%	6,4%	2,8%	1,4%	0,0%			113,98	-0,05%		13,49%	#VALUE!
Cash		1,0%	1,0%	1,0%	1,0%	1,0%							
Total		100,0%	100,0%	100,0%	100,0%	100,0%							

(*) For Uaggr Portfolio

СТРУКТУРА ОБЛИГАЦИОННОЙ ЧАСТИ

Bonds		09.09.2022							
ISIN	Security_Name	Modified Duration / Effective Duration*	YTM						
		Portfolio	RUGT3 Index	RUCBITR Index	RGBITR Index	Portfolio	RUGT3 Index	RUCBITR Index	RGBITR Index
RU000A1007F4	RFLB 7.4 07/17/24	1,72				5,59%			
RU000A101QE0	RFLB 4 1/2 07/16/25	2,57				6,92%			
RU000A100A82	RFLB 7.65 04/10/30	5,65				8,04%			
RU000A100EG3	RFLB 7.15 11/12/25	2,81				6,56%			
RU000A0JVV48	RFLB 8 1/2 09/17/31	6,30				8,05%			
RU000A1002S8	VTBB ETF Corp Bonds Smart Beta	1,61				9,51%			
RU000A1047H6	INFL ETF Ingosstrakh	4,75				7,74%			
RU000A103CA4	Ingosstrakh Russian Corporate	1,20				8,75%			
		2,70	1,95	1,98	4,46	8,34%	7,84	8,89	8,40
(*) Effective Duration for Floater		(*)							
INFL YTM Base	3,740%								
Inflation forecast	4,000%								

АКЦИОННАЯ ЧАСТЬ vs. ИНДЕКС

Инструмент	Вес, %					Доходность за неделю, %	Доходность, %		Альфа, %
	Портфель	Индекс	OW / UW	ИИ	OW / UW		Портфель	Индекс	
	100,0%	98,7%			99,9%				
Газпром, акция об.	9,3%	12,2%	-2,9%	0,0%	-12,2%	-2,95%	-0,27%	-0,36%	0,09%
Polymetal International, акция об.	0,0%	1,2%	-1,2%	0,0%	-1,2%	6,23%	0,00%	0,07%	-0,07%
Яндекс, акция об.	0,0%	5,7%	-5,7%	0,0%	-5,7%	-2,65%	0,00%	-0,15%	0,15%
ОК РУСАЛ, акция об.	0,0%	1,2%	-1,2%	0,0%	-1,2%	-0,62%	0,00%	-0,01%	0,01%
Северсталь, акция об.	0,0%	1,3%	-1,3%	0,0%	-1,3%	1,08%	0,00%	0,01%	-0,01%
TCS Group, деп. расп.	0,0%	2,8%	-2,8%	0,0%	-2,8%	0,74%	0,00%	0,02%	-0,02%
Сургутнефтегаз, акция об.	0,0%	2,0%	-2,0%	0,0%	-2,0%	-3,54%	0,00%	-0,07%	0,07%
Сургутнефтегаз, акция прив.	0,0%	1,4%	-1,4%	13,9%	12,5%	-2,56%	0,00%	-0,04%	0,04%
НЛМК, акция об.	0,0%	1,3%	-1,3%	10,0%	8,7%	-3,87%	0,00%	-0,05%	0,05%
ГМК Норильский никель, акция об.	5,9%	8,1%	-2,1%	11,2%	3,2%	-0,04%	0,00%	0,00%	0,00%
ММК, акция об.	0,0%	0,6%	-0,6%	0,0%	-0,6%	-3,38%	0,00%	-0,02%	0,02%
Фикс Прайс, деп. расп.	0,0%	0,4%	-0,4%	0,0%	-0,4%	-1,81%	0,00%	-0,01%	0,01%
ЭН+ ГРУП, акция об.	0,0%	0,4%	-0,4%	0,0%	-0,4%	2,57%	0,00%	0,01%	-0,01%
НОВАТЭК, акция об.	6,9%	6,3%	0,6%	0,0%	-6,3%	0,97%	0,07%	0,06%	0,01%
Роснефть, акция об.	4,3%	3,8%	0,5%	0,0%	-3,8%	-1,84%	-0,08%	-0,07%	-0,01%
АФК Система, акция об.	0,0%	0,4%	-0,4%	0,0%	-0,4%	2,46%	0,00%	0,01%	-0,01%
Банк ВТБ (ПАО), акция об.	0,0%	0,8%	-0,8%	0,0%	-0,8%	-1,14%	0,00%	-0,01%	0,01%
Московская Биржа, акция об.	0,0%	1,2%	-1,2%	0,0%	-1,2%	-0,67%	0,00%	-0,01%	0,01%
МТС, акция об.	0,0%	1,8%	-1,8%	13,9%	12,1%	-1,06%	0,00%	-0,02%	0,02%
HeadHunter, деп. расп.	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-3,29%	0,00%	0,00%	0,00%
Сбербанк России, акция прив.	0,0%	1,1%	-1,1%	0,0%	-1,1%	-3,62%	0,00%	-0,04%	0,04%
VK Company Ltd, деп. расп.	0,0%	0,5%	-0,5%	0,0%	-0,5%	4,15%	0,00%	0,02%	-0,02%
Московский кредитный банк, акция об.	0,0%	0,4%	-0,4%	0,0%	-0,4%	3,66%	0,00%	0,01%	-0,01%

АКЦИОННАЯ ЧАСТЬ vs. ИНДЕКС

Инструмент	Вес, %			Доходность инструмента			Доходность, %		Альфа, %
	Портфель	Индекс	OW / UW	за неделю, %			Портфель	Индекс	
Татнефть, акция прив.	0,0%	0,5%	-0,5%	0,0%	-0,5%	-2,41%	0,00%	-0,01%	0,01%
Ростелеком, акция об.	0,0%	0,5%	-0,5%	0,0%	-0,5%	-0,84%	0,00%	0,00%	0,00%
Детский мир, акция об.	0,0%	0,3%	-0,3%	0,0%	-0,3%	-2,52%	0,00%	-0,01%	0,01%
ИНТЕР РАО, акция об.	0,0%	1,0%	-1,0%	0,0%	-1,0%	0,09%	0,00%	0,00%	0,00%
Globaltrans Investment PLC, деп. расп.	0,0%	0,3%	-0,3%	0,0%	-0,3%	-1,02%	0,00%	0,00%	0,00%
X5 Retail Group, деп. расп.	0,0%	1,3%	-1,3%	0,0%	-1,3%	-5,30%	0,00%	-0,07%	0,07%
Транснефть, акция прив.	0,0%	0,5%	-0,5%	0,0%	-0,5%	-2,61%	0,00%	-0,01%	0,01%
Аэрофлот, акция об.	0,0%	0,3%	-0,3%	0,0%	-0,3%	-1,16%	0,00%	0,00%	0,00%
РусГидро, акция об.	0,0%	0,7%	-0,7%	12,9%	12,2%	-2,00%	0,00%	-0,01%	0,01%
Татнефть, акция об.	7,8%	2,7%	5,2%	0,0%	-2,7%	-2,02%	-0,16%	-0,05%	-0,10%
Полюс, акция об.	7,8%	2,1%	5,7%	7,4%	5,3%	-2,03%	-0,16%	-0,04%	-0,12%
Озон, деп. расп.	0,0%	0,7%	-0,7%	0,0%	-0,7%	-6,43%	0,00%	-0,04%	0,04%
Магнит, акция об.	3,6%	3,2%	0,3%	0,0%	-3,2%	0,25%	0,01%	0,01%	0,00%
ПИК-Специализированный застройщик, акция об.	7,8%	1,0%	6,9%	0,0%	-1,0%	-0,03%	0,00%	0,00%	0,00%
Сбербанк России, акция об.	14,0%	12,1%	1,8%	0,0%	-12,1%	-3,93%	-0,55%	-0,48%	-0,07%
Лукойл, акция об.	10,9%	14,4%	-3,5%	0,0%	-14,4%	-2,72%	-0,30%	-0,39%	0,09%
АЛРОСА, акция об.	7,8%	0,3%	7,6%	0,0%	-0,3%	1,31%	0,10%	0,00%	0,10%
ФосАгро, акция об.	7,8%	2,3%	5,6%	0,0%	-2,3%	-2,74%	-0,21%	-0,06%	-0,15%
Фонд Золото	5,0%	0,0%	5,0%	0,0%	0,0%	-0,64%	-0,03%	0,00%	-0,03%
Фонд Денежного рынка	0,0%	0,0%	0,0%	29,7%	29,7%	0,13%	0,00%	0,00%	0,00%
Денежные средства, руб.	1,0%	0,0%	1,0%	1,0%	1,0%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%