

## «Альфа-Капитал Квант»

### Общая информация<sup>1</sup>

<b>СЧА</b>	407,8 млн руб.
<b>Валюта</b>	рубли
<b>Классы активов</b>	акции
<b>Активы, определяющие цену пая</b>	акции, обращающиеся на Мосбирже <sup>2</sup>

### Изменение расчетной цены одного пая (iNAV)<sup>3</sup>

<b>1 мес.</b>	-2,4%
<b>3 мес.</b>	9,6%
<b>6 мес.</b>	0,5%
<b>1 год</b>	7,2%
<b>С запуска (24.09.2021)</b>	10,4%

### События и комментарии

По итогам месяца цена пая скорректировалась на 2,4%, тогда как индекс МосБиржи снизился на 7,3%. В течение месяца мы сокращали сектор телекоммуникаций в портфеле, увеличив долю денежных средств. Мы продолжаем аккумулировать данные после перехода на российские акции для детального анализа работы стратегии на новом рынке (выбор бумаг, качество сигналов, ценовые искажения и т.п.).

Напомним, что фонд был переведен окончательно на российские ценные бумаги в начале года, и с этого момента его результаты сильно опережают динамику индекса широкого рынка. Это обеспечено, как и прежде, за счет тщательного выбора бумаг и моментов входа и выхода из позиций разработанными нами алгоритмами машинного обучения и элементами ИИ.

Отметим также, что на российском рынке по-прежнему мало подобных стратегий, тем более успешных. Это позволяет используемым алгоритмам пользоваться возникающими рыночными аномалиями, выявлять характерные ценовые движения в бумагах, предшествующие сильным ценовым движениям.

Ожидания по фонду остаются благоприятными.

### Расчетная цена инвестиционного пая (iNAV)<sup>4</sup>



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.

1 – Данные по состоянию на 31.05.2024. 2 – Акции могут включаться состав портфеля как напрямую, так и через покупку ETF, в портфель которых они входят. 3 – iNAV БПИФа «Альфа-Капитал Квант» по состоянию на 31.05.2024. 4 – Данные для графика соответствуют данным на сайтах Мосбиржи и InvestFunds.  
БПИФ рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Квант». Правила доверительного управления № 4580 зарегистрированы Банком России от 06.09.2021. ООО УК «Альфа-Капитал». Лицензия на осуществление деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами и негосударственными пенсионными фондами № 21-000-1-00028 от 22.09.1998 выдана ФСФР России. Подробную информацию о деятельности ООО УК «Альфа-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: 123001, Москва, ул. Садовая-Кудринская, д. 32, стр. 1. Тел.: (495) 783-4-783, 8 (800) 200-28-28, www.alfacapital.ru. Не является индивидуальной инвестиционной рекомендацией. Управляющая компания обращает внимание, что, в соответствии с пунктом 7 статьи 21 Федерального закона от 29.11.2001 № 156 «Об инвестиционных фондах», инвестиционные паи биржевого паевого инвестиционного фонда при их выдаче могут приобретать только уполномоченные лица. Сообщение не является индивидуальной инвестиционной рекомендацией. Упоминаемые в данном сообщении финансовые инструменты могут не подходить соответствующему клиенту.