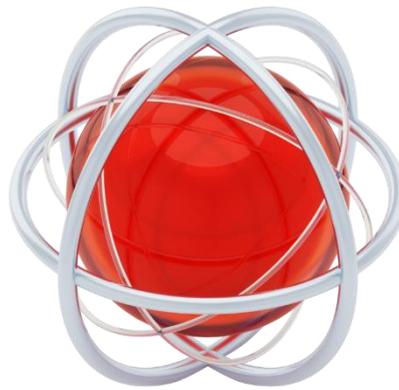


# Альфа-Капитал Квант

**Акции с участием искусственного интеллекта**



## Комментарий по рынку

В январе стратегия выглядела чуть лучше рынка, по итогам месяца индекс МосБиржи вырос на 5,8%, тогда как паи фонда выросли на 6,4%. В течение месяца не было закрытых сделок, а в структуре фонда на конец месяца преобладали нефтегазовый и сырьевой секторы.

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.). Пока мы видим резкое улучшение результатов после перехода с рынка США на российский рынок акций, что связываем с нынешними особенностями нашего рынка, благоприятными для подобного типа стратегий.

Напомним, что до переориентации на российский рынок акций в конце 2023 года основным активом в БПИФе были акции компаний, обращающиеся на рынке США. И раз стратегия была успешной там, на очень эффективном рынке, то она сможет успешно работать и на российском. Российский рынок гораздо менее эффективен, здесь дольше сохраняются ценовые искажения, позволяющие зарабатывать дополнительную доходность.

## Общая информация<sup>1</sup>

**СЧА** 409,2 млн руб.

**Основной класс активов** акции

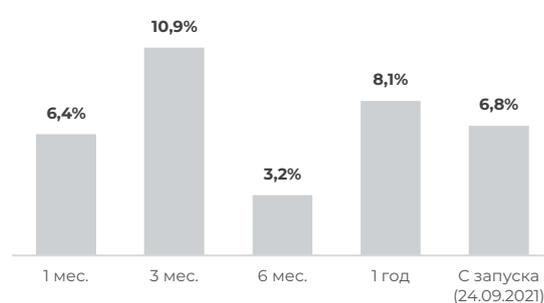
## Топ-10 эмитентов<sup>1</sup>

<b>Сбербанк России</b>	7,2%
<b>ЛУКОЙЛ</b>	6,9%
<b>Т-Технологии</b>	6,6%
<b>Газпром</b>	6,0%
<b>МКПАО «Яндекс»</b>	5,7%
<b>Полюс</b>	5,7%
<b>Аэрофлот</b>	5,5%
<b>Татнефть</b>	5,4%
<b>Сургутнефтегаз</b>	5,3%
<b>Московская Биржа</b>	5,1%

## Динамика стоимости пая<sup>1</sup>



## Изменение стоимости пая<sup>1</sup>



## Портфельный управляющий

Виктор Барк



СТОИМОСТЬ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ПАЕВ МОЖЕТ УВЕЛИЧИВАТЬСЯ И УМЕНЬШАТЬСЯ, РЕЗУЛЬТАТЫ ИНВЕСТИРОВАНИЯ В ПРОШЛОМ НЕ ОПРЕДЕЛЯЮТ ДОХОДОВ 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.

<sup>1</sup> По состоянию на 28.12.2024. Стоимость пая указана с учетом дробления паев с коэффициентом 1:100, произошедшим 27.09.2024. Подробная информация указана на [сайте](#) «Управляющей компании «Альфа-Капитал», БПИФ рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Квант». Правила доверительного управления № 4580 зарегистрированы Банком России 06.09.2021.

Общество с ограниченной ответственностью «Управляющая компания «Альфа-Капитал». Лицензия ФСФР № 21-000-1-00028 от 22.09.1998. Лицензия ФСФР № 077-08158-001000 от 30.11.2004. Правилами доверительного управления паевыми инвестиционными фондами, находящимися под управлением ООО УК «Альфа-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. Информацию о деятельности ООО УК «Альфа-Капитал» и фондах под ее управлением можно получить на сайте [www.alfacapital.ru](http://www.alfacapital.ru) и по адресу: Москва, ул. Садовая-Кудринская, д. 32, стр. 1, тел. +7 (495) 783-4-783. Не является индивидуальной инвестиционной рекомендацией.