

Альфа-Капитал Квант

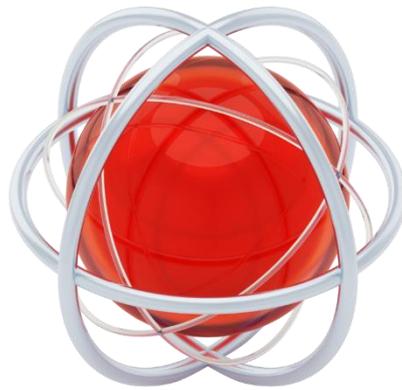
Акции с участием искусственного интеллекта

Комментарий по рынку

По итогам месяца стоимость пая скорректировалась на -2,8%, тогда как индекс МосБиржи снизился на -3,1%. В течение месяца были закрыты две позиции в портфеле. В структуре фонда преобладали нефтегазовый и IT-секторы.

В основе алгоритма лежит распознавание начала растущего тренда в отдельных бумагах на основе характера ценовых движений. Они, в свою очередь, и отражают изменения настроений инвесторов. Большую часть времени такой подход дает отличные результаты, но в условиях быстрых и особо сильных изменений новостного фона система не успевает реагировать на такие изменения, и качество сигналов резко снижается. Именно это и наблюдается с конца прошлого года.

Полагаем, что по мере нормализации движений на рынке акций качество работы алгоритма восстановится, что позволит ему снова показать опережающую динамику.



RU000A103NRS

Общая информация¹

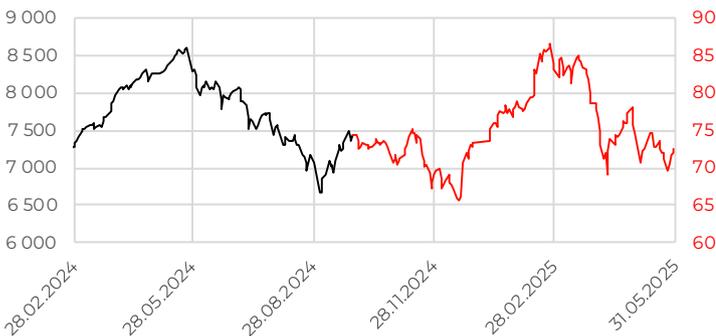
СЧА 504,2 млн руб.

Основной класс активов акции

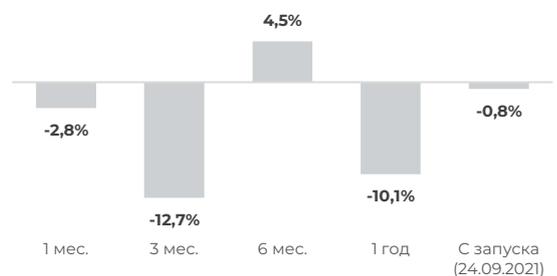
Топ-10 эмитентов¹

Сбербанк России	7,2%
Т-Технологии	6,4%
Аэрофлот	6,0%
МКПАО «Яндекс»	6,0%
Газпром	5,4%
НОВАТЭК	5,1%
Полюс	5,1%
МКПАО «Хэдхантер»	5,1%
Совкомбанк	5,1%
Татнефть	5,0%

Динамика стоимости пая¹



Изменение стоимости пая¹



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.

¹ По состоянию на 30.05.2025. 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 и по адресу: Москва, ул. Садовая-Кудринская, д. 32, стр. 1, тел. +7 (495) 783-4-783. Не является индивидуальной инвестиционной рекомендацией.