

Альфа-Капитал Квант

Акции с участием искусственного интеллекта

+11,77%*

Комментарий по рынку

По итогам месяца стоимость пая фонда выросла на 0,2%, тогда как индекс МосБиржи снизился на 4,0%. В течение месяца не было закрытых позиций в портфеле. В структуре фонда преобладали нефтегазовый и банковский секторы.

В основе алгоритма лежит распознавание начала растущего тренда в отдельных бумагах на основе характера ценовых движений. Они, в свою очередь, 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.

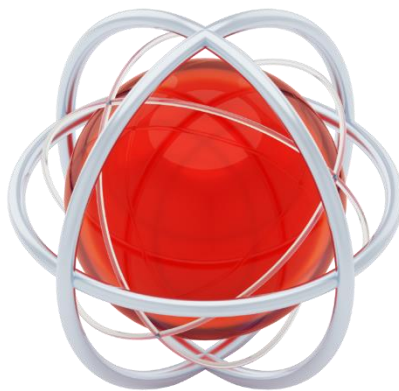
Полагаем, что по мере нормализации движений на рынке акций качество работы алгоритма восстановится, что позволит ему снова показать опережающую динамику.

Динамика стоимости пая¹



Портфельный управляющий

Никита Эленбергер



RU000A103NR5

Общая информация¹

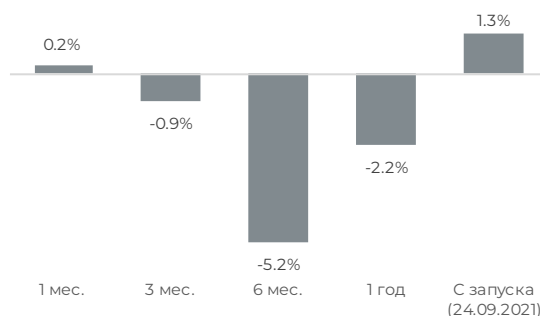
СЧА 520 млн руб.

Основной класс активов акции

Топ-10 эмитентов¹

Сбербанк России	6,9%
Т-Технологии	6,1%
Совкомбанк	6,0%
МТС	6,0%
МКПАО «Яндекс»	5,8%
АФК «Система»	5,7%
МКПАО «Хэдхантер»	5,5%
Транснефть	5,5%
НОВАТЭК	5,5%
Аэрофлот	4,9%

Изменение стоимости пая¹



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 ПАИ, СЛЕДУЕТ ВНИМАТЕЛЬНО ОЗНАКОМИТЬСЯ С ПРАВИЛАМИ ДОВЕРИТЕЛЬНОГО УПРАВЛЕНИЯ ПАЕВЫМ ИНВЕСТИЦИОННЫМ ФОНДОМ.

*Доходность фонда за период с 18.12.2024 по 01.07.2025.

¹ По состоянию на 31.07.2025. 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.