

Биржевой паевой инвестиционный фонд

Альфа-Капитал Квант

Акции с участием искусственного интеллекта
Сценарные прогнозы на горизонте 1 года*

Позитивный	Базовый	Негативный
+33,1%	+20,5%	+7,8%

Комментарий по рынку

В ноябре рынок акций по-прежнему оставался под влиянием геополитики. На фоне очередного раунда переговорного процесса между Россией и США на рынке снова сформировалась повышенная волатильность. По итогам месяца индекс Мосбиржи вырос на 6%, причем почти весь этот рост произошел в течение 2 дней.

Фонд по итогам ноября в плюсе на 4,3%. Эмоциональные качели продолжают негативно сказываться на результатах работы алгоритма, который ориентирован на более длинные тренды. В условиях резких изменений новостного фона и избыточно эмоциональной реакции на них рынка надежность сигналов ухудшается. Тем не менее такие периоды хотя и могут тянуться долго, все равно заканчиваются.

В фонде на конец месяца преобладали нефтегазовый и банковский секторы, которые по ценовым движениям выглядят локально недооцененными. Также была повышенная доля денежных средств в портфеле.

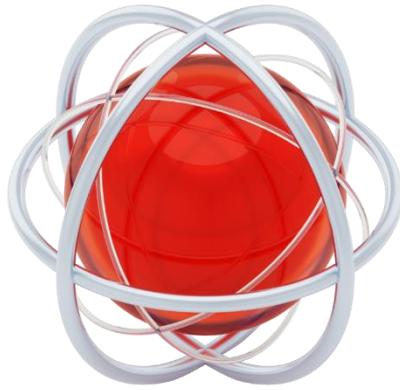
Динамика стоимости пая

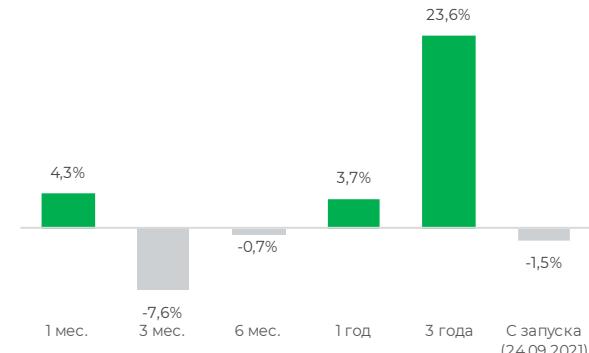
Портфельный управляющий
 Эленбергер Никита

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.

*Сценарные прогнозы (далее - Сценарии) рассчитаны на основании портфеля активов, составляющих имущество фонда в соответствии с Методикой расчета сценарных прогнозов открытых и биржевых паевых инвестиционных фондов под управлением УК "Альфа-Капитал", размещенной на сайте управляющей компании по адресу <https://www.alfacapital.ru/disclosure/clients.info>. Сценарии отражают аналитическую оценку потенциальной динамики совокупного портфеля активов за вычетом лимитированных в соответствии с правилами доверительного управления фондом размеров расходов и вознаграждений, подлежащих оплате за счет имущества фонда, и не являются гарантами или обещанием достижения соответствующих результатов в будущем. Инвестирование в финансовые инструменты сопряжено с рисками, в том числе с риском частичной потери инвестиционных средств в связи с возможным неблагоприятным влиянием разного рода факторов. Фактические результаты инвестирования могут отличаться от представленных в расчетах Сценарии. Расчеты Сценарии ООО УК «Альфа-Капитал» осуществляются с использованием данных Сервиса прогнозов АО Петербургская Биржа.

БПИФ рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Квант». Правила доверительного управления № 4580 зарегистрированы Банком России 06.09.2021. Лицензия ФСФР № 21-0001-00028 от 22.09.1998. Лицензия ФСФР № 077-0815B-00100 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.


AKQU
RU000A103NR5

Изменение стоимости пая

Общая информация

СЧА	432 млн руб.
Основной класс активов	акции

Топ-10 эмитентов

Сбербанк России	8,2%
МТС	7,3%
Т-Технологии	7,2%
МКПАО Яндекс	7,0%
Транснефть	6,9%
МКПАО Хэдхантер	6,2%
Газпром	6,0%
Совкомбанк	5,9%
АФК Система	5,1%
ФосАгро	4,6%