

Методика расчета ключевого индикатора

Управляющая компания использует специальный индикатор для оценки того, насколько успешно реализуется инвестиционная стратегия активного управления ОПИФ рыночных финансовых инструментов «ЛЕВЧЕНКО». Этот индикатор строится на основе двух ключевых биржевых индексов.

Какие индексы используются?

- 1) Индекс Московской Биржи и Индекс РТС (IMOEX)
 - что это: ценовой индекс, взвешенный по рыночной капитализации (free-float);
 - что включает: наиболее ликвидные акции крупнейших российских компаний из основных секторов экономики;
 - как рассчитывается: на основе рыночной стоимости акций с учётом доли акций в свободном обращении;
 - где посмотреть: сайт Московской биржи — <https://www.moex.com/ru/index/IMOEX> ;
 - оператор: ПАО «Московская биржа ММББ-РТС» (ОГРН 1027739387411).
- 2) Индекс государственных облигаций Московской Биржи (RGBITR)
 - что это: основной индикатор рынка российского государственного долга;
 - что включает: наиболее ликвидные облигации федерального займа (ОФЗ) с дюрацией более одного года;
 - как рассчитывается: в режиме реального времени по методам совокупного дохода и чистых цен;
 - где посмотреть: сайт Московской биржи — <https://www.moex.com/ru/index/RGBITR>;
 - оператор: ПАО «Московская биржа ММББ-РТС» (ОГРН 1027739387411).

Как формируется индикатор?

Индикатор рассчитывается как среднее взвешенное изменений двух индексов:

Индикатор = $50\% \times \text{изменение IMOEX} + 50\% \times \text{изменение RGBITR}$

Это означает, что:

- половина веса приходится на динамику фондового рынка (IMOEX);
- половина веса — на динамику рынка гособлигаций (RGBITR).

Кто рассчитывает индикатор?

Расчёт индикатора выполняет:

ООО «УК «РЕКОРД КАПИТАЛ»

ОГРН: 1137746080768

Сайт: <https://recordcap.ru/>

Зачем это нужно?

Такой подход позволяет:

- объективно оценивать результаты управления активами;
- сравнивать доходность инвестиционного портфеля с рыночными индикаторами;
- корректировать стратегию управления в зависимости от рыночной динамики.