



МЫ первые*

*В 1996 году «Паллада Эссет Менеджмент» зарегистрировала 1-ый ОПИФ в России - открытый паевой инвестиционный фонд облигаций «Паллада-облигации». Правила № 0001-44504664 от 12.09.1996 г. ФКЦБ РФ.

30 июня 2015 года

Ежемесячный информационный бюллетень по паевым инвестиционным фондам

Основные показатели рынка на 30 июня 2015 года

Показатель	индекс ММВБ	индекс РТС	индекс РТС-2	USDRUB	USDEUR BKT	Brent
Значение	1 654,55	939,93	797,72	55,30	58,22	\$63,14
Изменение за месяц	2,82%	-2,98%	-5,52%	5,72%	5,39%	-3,14%

Основные показатели фондов

ПИФ	Тип	Стратегия	Дата регистрации	Стоимость пая	СЧА
Открытые ПИФы					
Золото	фондов	паи ETF, ориентированные на индекс золота	12.09.1996	150,55 руб.	2,4 млн. руб.
Сапфир	облигации	перспективные облигации	21.01.2004	2258,65 руб.	11,57 млн. руб.
Изумруд - Индекс ММВБ	индексный	акции в соответствии с индексом ММВБ	25.05.2005	1040,19 руб.	13,37 млн. руб.
Гранат	смеш. инвестиций	"голубые фишки" + облигации	21.01.2004	2393,56 руб.	285,37 млн.руб.
Интервальные ПИФы					
Алмаз	акции	перспективные акции 1-2 эшелона	10.03.2004	1142,96 руб.	65,87 млн руб.

Доходность ПИФов под управлением ЗАО "Паллада"

ПИФ	1 мес	3 мес	6 мес	1 год	3 года	с начала управления
Золото	3,88%	-6,04%	-3,60%	23,94%	35,56%	1114,70%
Сапфир	0,00%	5,68%	8,99%	3,10%	15,23%	125,87%
Изумруд - Индекс ММВБ	-0,66%	1,61%	17,89%	14,47%	25,77%	4,02%
Гранат	-1,65%	1,33%	11,04%	8,04%	-7,15%	139,36%
Алмаз	0,10%	1,07%	13,57%	11,59%	-3,93%	14,30%

Показатели риска и качества управления*

ПИФ	Коэфф. Шарпа	Коэфф. Сортино	β	R2	VaR	Волатильность
Золото	0,033	0,049	0,365	7,95%	-10,19%	6,84%
Сапфир	-0,192	-0,153	0,047	4,41%	-1,53%	1,17%
Изумруд - Индекс ММВБ	0,004	0,004	0,961	94,66%	-7,82%	5,22%
Гранат	-0,220	-0,234	0,608	73,33%	-6,32%	3,76%
Алмаз	-0,182	-0,201	0,549	51,87%	-6,66%	4,03%

* по данным investfunds.ru