

## Методология расчета доходности фондов за 1 год

Дата: 13.07.2020

Цель исследования: определение рублевой доходности 3-х фондов FinEx: FinEx Gold UCITS ETF (FXGD), FinEx China UCITS ETF (FXCN), FinEx USA IT UCITS ETF (FXIT), FinEx Global Equity UCITS ETF (FXWO, FXRW) за период с 10.07.2019 по 10.07.2020.

1. Доходность фондов FXGD, FXCN, FXIT рассчитана как отношение значений стоимости чистых активов (СЧА) фонда на одну акцию, переведённые в рубли [по курсу ЦБ РФ](#), на 10.07.2019г. и 10.07.2020г. в процентах. Формула доходности:

$$\left( \frac{(\text{СЧА фонда на одну акцию на 10.07.2020})^1 \times \text{курс доллара на 10.07.2020}^2}{(\text{СЧА фонда на одну акцию на 10.07.2019})^1 \times \text{курс доллара на 10.07.2019}^2} - 1 \right) \times 100\%$$

$$\text{FXGD} = \left( \frac{12,34 \times 70,88}{9,617 \times 63,76} - 1 \right) \times 100\% = 41,9\%$$

$$\text{FXCN} = \left( \frac{50,3 \times 70,88}{39,23 \times 63,76} - 1 \right) \times 100\% = 42,5\%$$

$$\text{FXIT} = \left( \frac{107,97 \times 70,88}{79,17 \times 63,76} - 1 \right) \times 100\% = 41,6\%$$

2. Доходность фонда FXWO рассчитана как отношение значений индекса Solactive Large Cap Select Index [в долларах](#) на 17.02.2019г. и 17.02.2020г. в процентах. Доходность не учитывает комиссию фонда. Формула доходности:

$$\left( \frac{(\text{СЧА фонда на одну акцию на 17.02.2020})^1}{(\text{СЧА фонда на одну акцию на 17.02.2019})^1} - 1 \right) \times 100\%$$

$$\text{FXWO (index return)} = \left( \frac{1374,24}{1245,2} - 1 \right) \times 100\% = 10,4\%$$

---

<sup>1</sup> По информации с сайта Банка России

<sup>2</sup> По информации с сайта Московской Биржи