

# Методология расчета доходности фондов за 1 год

Дата: 26.08.2021

Цель исследования: определение рублевой доходности 5-х фондов FinEx: FinEx USA UCITS ETF (FXUS), FinEx China UCITS ETF (FXCN), FinEx USA IT UCITS ETF (FXIT), FinEx USA IT UCITS ETF miniShares (FXIM), FinEx Global Equity UCITS ETF with rub hedge (FXRW), и долларовой индикативной доходности для FinEx Global Equity UCITS ETF

1. Доходность фондов FXIT, FXRL, FXUS, FXWO рассчитана как отношение значений стоимости чистых активов (СЧА) фонда на одну акцию, переведённые в рубли [по курсу ЦБ РФ](#), на 25.08.2020г. и 25.08.2021г. в процентах. Доходность фонда FXWO рассчитана как отношение значений стоимости чистых активов (СЧА) фонда на одну акцию в долларах на 25.08.2020г. и 25.08.2021г. в процентах. Формула доходности:

$$\frac{(\text{СЧА фонда на одну акцию на 25.08.2021})^1 \times \text{курс доллара на 25.08.2021}^2}{(\text{СЧА фонда на одну акцию на 25.08.2020})^1 \times \text{курс доллара на 25.08.2020}^2} - 1 \times 100\%$$

$$FXIT = \frac{158.17 \times 73.95}{118.25 \times 74.42} - 1 \times 100\% = 32.9\%$$

$$FXRL = \frac{57.01 \times 73.95}{41.66 \times 74.42} - 1 \times 100\% = 36.0\%$$

$$FXUS = \frac{82.53 \times 73.95}{62.53 \times 74.42} - 1 \times 100\% = 31.1\%$$

$$FXWO = \frac{0.025}{0.021} - 1 \times 100\% = 19.0\%$$

2. Доходность фондов FXIT, FXRL, FXUS, FXWO рассчитана как отношение значений стоимости чистых активов (СЧА) фонда на одну акцию, переведённые в рубли [по курсу ЦБ РФ](#), на 25.08.2020г. и 25.08.2021г. в процентах.

$$FXRW = \frac{(\text{СЧА фонда на одну акцию на 25.08.2021})^1}{(\text{СЧА фонда на одну акцию на 25.08.2020})^1} - 1 \times 100\% = \frac{1.291}{1.035} - 1 \times 100\% = 24.7\%$$

3. Указанная доходность для фондов FXFA, FXDM, FXES, FXTP является **индикативной** и рассчитана как отношение значений соответствующего индекса, переведённые в рубли [по курсу ЦБ РФ](#), на 25.08.2020г. и 25.08.2021г. в процентах. Доходность не учитывает комиссию фонда. Формула доходности:

$$\frac{(\text{Стоимость индекса на 25.08.2021}) \times \text{курс доллара на 25.08.2021}^2}{(\text{Стоимость индекса на 25.08.2020}) \times \text{курс доллара на 25.08.2020}^2} - 1 \times 100\%$$

$$FXFA = \frac{1,071.45 \times 73.95}{951.38 \times 74.42} - 1 \times 100\% = 11.9\%$$

$$FXDM = \frac{1,757.53 \times 73.95}{1,385.26 \times 74.42} - 1 \times 100\% = 26.1\%$$

$$FXES = \frac{6,747.49 \times 73.95}{5,978.81 \times 74.42} - 1 \times 100\% = 12.1\%$$

$$FXTP = \frac{1,055.27 \times 73.95}{991.11 \times 74.42} - 1 \times 100\% = 5.8\%$$

4. Указанная доходность для фондов FXIP и FXRD является **индикативной** и рассчитана как отношение значений соответствующего индекса с учетом рублевого хеджа в рублях на 25.08.2020г. и 25.08.2021г. в процентах. Доходность не учитывает комиссию фонда.  
Формула доходности:

$$\frac{(\text{Стоимость индекса на 25.08.2021})}{(\text{Стоимость индекса на 25.08.2020})} - 1 \times 100\%$$

$$FXIP = \frac{104.65}{94.01} - 1 \times 100\% = 11.3\%$$

$$FXRD = \frac{101.34}{86.12} - 1 \times 100\% = 17.7\%$$

---

<sup>1</sup> По информации с сайта Bloomberg

<sup>2</sup> По информации с сайта Банка России