

Методология расчета доходности фондов за 3 года

Дата: 20.08.2019

Цель исследования: определение рублевой доходности 3-х фондов FinEx: FinEx Russian RTS UCITS ETF (FXRL), FinEx USA UCITS ETF (FXUS), FinEx USA IT UCITS ETF (FXIT) за период с 19.08.2016 по 20.08.2019.

1. Доходность фондов рассчитана как отношение значений стоимости чистых активов (СЧА) фонда на одну акцию, переведённые в рубли по курсу ЦБ РФ, на 19.08.2016г. и 19.08.2019г. в процентах. Формула доходности:

$$\left(\frac{(\text{СЧА фонда на одну акцию на 20.08.2019}) * \text{курс доллара на 19.08.2019}}{(\text{СЧА фонда на одну акцию на 19.08.2016}) * \text{курс доллара на 19.08.2016}} - 1 \right) * 100\%$$

Курс доллара взят с сайта ЦБ РФ¹ и равен 63,54 на 19.08.2016 и 66,08 на 20.08.2019.

Значения СЧА фондов взяты с сайта Московской Биржи.

$$\text{FXRL} = \left(\frac{39,8 * 66,08}{26,54 * 63,54} - 1 \right) * 100\% = 55,9\%$$

$$\text{FXUS} = \left(\frac{51,57 * 66,08}{38,17 * 63,54} - 1 \right) * 100\% = 40,5\%$$

$$\text{FXIT} = \left(\frac{77,2 * 66,08}{43,75 * 63,54} - 1 \right) * 100\% = 83,5\%$$

¹ https://www.cbr.ru/currency_base/dynamics/