

Инвестиционная цель

Достижение инвестиционного результата, максимально приближенного к динамике индекса РТС.

Предмет инвестирования

Акции российских компаний, входящие в расчет Индекса РТС.

Инвестиционная стратегия

Поддержание инвестиционного портфеля, динамика которого будет максимально точно повторять динамику индекса РТС. С этой целью состав фонда максимально приближен к структуре индекса РТС, и доля ценных бумаг, по которым рассчитывается Индекс РТС, должна составлять не менее 85% стоимости активов фонда.

Динамика стоимости пая

На 31 июля 2007	Ренессанс - Индекс РТС	Индекс РТС
Июль	3.6%	4.2%
3 месяца	1.4%	2.7%
6 месяцев	2.0%	4.4%
9 месяцев	16.5%	18.3%
12 месяцев	п.а.	п.а.
С начала года	-1.3%	0.9%
С открытия фонда	14.5%	16.2%
Лучший месяц с открытия фонда	9.3%	8.3%
Худший месяц с открытия фонда	-8.8%	-7.2%

	Янв	Фев	Мар	Апр	Май	Июл	Авг	Сент	Окт	Ноя	Дек
2006										9.3	7.9
2007	-3.2	-1.9	4.5	-1.9	-8.8	7.2	3.6				

Общая информация

Стоимость пая, руб.	1 145.44
Стоимость чистых активов, руб.	104 399 829.83
Длительность работы фонда, месяцы	9
Дата открытия фонда	20 октября 2006 г.
Рекомендуемый горизонт инвестирования	1-2 года
Управляющий Фондом	Андрей Иванов

Показатели качества управления*

Риск (стандартное отклонение)	2.6%	Коэффициент Шарпа	0.85
Бета (индекс РТС)	0.93	Коэффициент Трейнора	0.17
R ²	0.87	Безрисковая ставка, %	6.47%

Основные условия

Минимальный размер первичных инвестиций	1 000 000 руб.
Минимальный размер дополнительных инвестиций	250 000 руб.
Выплата денежных средств при погашении (макс.)	15 дней
Вознаграждения из средств фонда	Управляющей компании 1%
(% от среднегодовой стоимости чистых активов фонда)	включая НДС; депозитарию, регистратору, аудитору 0,5% включая НДС

Доходность с открытия фонда



Структура активов индекса РТС по секторам, %



Основные позиции индекса РТС, %



* Описание коэффициентов на <http://pif.rencap.com/indicator.aspx>

115035, Россия, Москва,
Садовническая ул. 82, стр. 2,
подъезд 7, "Аврора Бизнес Парк"

T. +7 (495) 744 55 66
8 (800) 100 55 66
pif@rencap.com
pif.rencap.com

© 2007 ООО «УК «Ренессанс Капитал». Все права защищены. Лицензия Федеральной комиссии по рынку ценных бумаг на осуществление деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами и негосударственными пенсионными фондами № 21-000-1.00141 от 14 ноября 2003 года. Лицензия Федеральной службы по финансовым рынкам № 077-99491-001000 от 5 сентября 2006 года на осуществление деятельности по управлению ценными бумагами. Открытый паевой инвестиционный фонд акций «Ренессанс - Акции» - правила доверительного управления фондом зарегистрированы ФСФР 18.08.2005 №0387-78483550. Открытый паевой инвестиционный фонд облигаций «Ренессанс - Облигации» - правила доверительного управления фондом зарегистрированы ФСФР 18.08.2005 №0388-78483550. Интервальный паевой инвестиционный фонд акций «Ренессанс - Перспектива» - правила доверительного управления фондом зарегистрированы ФСФР 18.08.2005 №0389-78483778. Открытый паевой инвестиционный фонд смешанных инвестиций «Ренессанс - Сбалансированный» - правила доверительного управления фондом зарегистрированы ФСФР 18.08.2005 №0390-78483778. Открытый паевой инвестиционный фонд облигаций «Ренессанс - Индекс РТС» - правила доверительного управления фондом зарегистрированы ФСФР 31.08.2006 №0599-94123312. Открытый паевой инвестиционный фонд облигаций «Ренессанс - Казначей» - правила доверительного управления фондом зарегистрированы ФСФР 08.05.2007 №0808-94127391. Закрытый паевой инвестиционный фонд недвижимости «Ренессанс - Недвижимость» - правила доверительного управления фондом зарегистрированы ФСФР 13.07.2006 №0556-94123233. Закрытый паевой инвестиционный фонд недвижимости «Ренессанс - Бизнес - Недвижимость» - правила доверительного управления фондом зарегистрированы ФСФР 26.12.2006 №0720-94121282. Стоимость инвестиционных паев может увеличиваться и уменьшаться, результаты инвестирования в прошлом не определяют доходы в будущем, государство не гарантирует доходность инвестиций в паевые инвестиционные фонды. Правила доверительного управления паевыми инвестиционными фондами предусматривают надбавку к расчетной стоимости инвестиционных паев при их выдаче и скидку к расчетной стоимости инвестиционных паев при их погашении. Взимание надбавок (скидок) уменьшит доходность инвестиций в инвестиционные паи паевых инвестиционных фондов. Прежде чем приобрести инвестиционный пай, следует внимательно ознакомиться с правилами доверительного управления паевыми инвестиционными фондами. Данный отчет содержит справочно-информационные и аналитические материалы и не имеет в качестве основной цели рекламирование финансовых услуг на рынке и не является рекламой. Информация, связанная с деятельностью ООО «УК «Ренессанс Капитал» по управлению паевыми инвестиционными фондами, публикуется на сайтах www.im.rencap.ru и pif.rencap.com, а также в информационном бюллетене "Приложение к Вестнику Федеральной службы по финансовым рынкам". Получить подробную информацию о паевых инвестиционных фондах, ознакомиться с правилами доверительного управления паевыми инвестиционными фондами, условиями управления активами до заключения соответствующего договора, получить информацию об ООО «УК «Ренессанс Капитал» и иную информацию, которая должна быть предоставлена в соответствии с федеральным законом и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации, можно по телефону (495) 744 55 66, 8 (800) 100 55 66 (бесплатно по России) или по адресу Москва, Садовническая ул., д. 82, стр. 2.