

Методология расчета доходности FXRL за 3 года

Дата: 20.08.2019

Цель исследования: определение рублевой доходности FinEx Russian RTS UCITS ETF (далее наименование по коду (тикеру) – FXRL) за период с 19.08.2016 по 20.08.2019.

1. Доходность FXRL в размере 55,9% рассчитана как отношение значений стоимости чистых активов (СЧА) фонда на одну акцию на 19.08.2016г. и 19.08.2019г. в процентах. Формула доходности FXRL:

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

Значения СЧА взяты с сайта Московской Биржи и равны 26,54 USD на 19.08.2016 и 39,8 на 20.08.2019. Курс доллара взят с сайта ЦБ РФ¹ и равен 63,54 на 19.08.2016 и 66,08 на 20.08.2019.

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

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