

ESGR ETF

Брокерское обслуживание в АО «Россельхозбанк»
<https://www.rshb.ru/stock/broker-service/>

БПИФ рыночных финансовых инструментов «РСХБ - Индекс МосБиржи - РСПП Вектор устойчивого развития, полной доходности, брутто (РСХБ Управление Активами)»

29 июня 2020 года Московская биржа начала торги ESGR ETF — первым в России БПИФ, инвестирующим в акции с высокими показателями ESG (ответственное инвестирование).

ESG (Экология, Социальная ответственность, Управление) — принципы развития компании, основанные на защите экологии, добросовестном отношении с сотрудниками и клиентами и правильном корпоративном управлении.

Параметры фонда

Benchmark	Индекс МосБиржи - РСПП Вектор устойчивого развития, полной доходности брутто (MRSVT)
Порог входа	от 1 000 руб.
Валюта	Рубли
Вознаграждение УК	0,8% в год
Комиссии и прочие расходы	не более 1,15% в год

- ✓ Первый и единственный в России БПИФ, соответствующий международным стандартам ESG.
- ✓ Ликвидность – покупка и продажа в любое время, мгновенная покупка.
- ✓ Низкий порог входа-доступен розничным инвесторам
- ✓ Исторически компании, входящие в Индекс МосБиржи – РСПП Вектор устойчивого развития, демонстрируют высокие результаты и привлекательные уровни дивидендной доходности.
- ✓ +23,6% – изменение Индекса МосБиржи - РСПП Вектор устойчивого развития за год против +14,9% – изменения Индекса МосБиржи за аналогичный период.¹
- ✓ Популярный на Западе принцип ответственного инвестирования набирает все большую популярность в России, так как считается, что следование ESG принципам может послужить дополнительным драйвером роста компании будущем.
- ✓ Возможность получения 3-х летнего налогового вычета.²

¹ Индексы полной доходности брутто – без учета налогообложения: MRSVT и MCFTR

² При удержании ценной бумаги в портфеле более трех лет инвестор имеет право подать на налоговый вычет в размере по 3 млн руб. в год за каждый полный год, по истечении трех лет. Таким образом, доход от торговых операций может быть освобожден от НДФЛ на сумму 9 млн рублей. Получение вычета возможно при условии, что ценные бумаги обращаются на Московской или Санкт-Петербургской бирже. На вычет могут претендовать владельцы акций, облигаций, инвестиционных паев открытых ПИФов, российских управляющих компаний. АО «Россельхозбанк» не несёт ответственности в случае отказа в получении льготы.

Источники: Московская Биржа, РСХБ УК

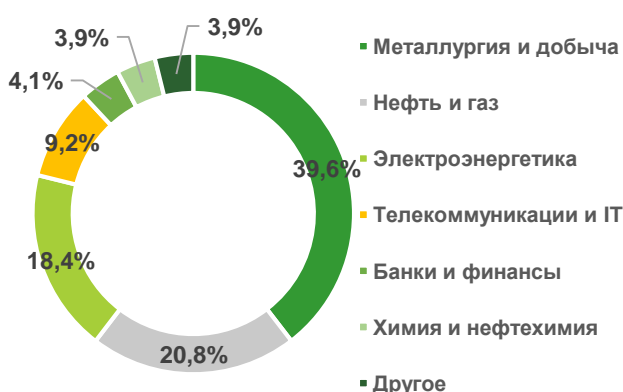
НЕ ЯВЛЯЕТСЯ ИНВЕСТИЦИОННОЙ РЕКОМЕНДАЦИЕЙ

ESGR ETF

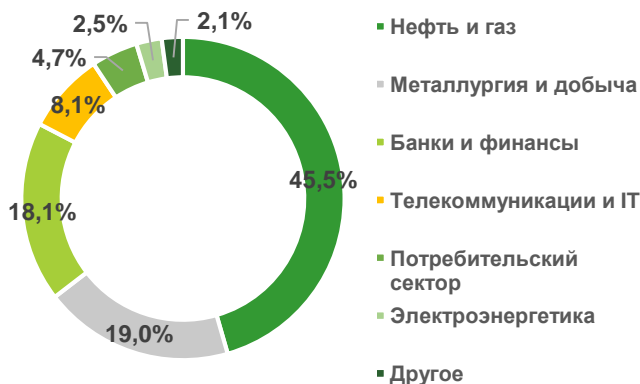
Брокерское обслуживание в АО «Россельхозбанк»
<https://www.rshb.ru/stock/broker-service/>

- ✓ В составе ESGR ETF находятся акции компаний, входящих в Индекс МосБиржи - "РСПП Вектор устойчивого развития", полной доходности брутто (MRSVT). В базу расчета данного индекса входят акции компаний, показавшие лучшую динамику показателей в сфере устойчивого развития и корпоративной социальной ответственности.
- ✓ В качестве сравнения взят Индекс МосБиржи полной доходности «брутто» (MCFTR), а также Индекс МосБиржи полной доходности 15 (MRBCTR), включающий наиболее ликвидные и капитализированные акции на МосБирже.
- ✓ Наибольшая доля индекса MRSVT приходится на сектор металлургии и добычи – 39,6%. Доля нефтегазового сектора в индексе MRSVT в половину ниже, чем в индексе Мосбиржи и составляет 20,8%.
- ✓ С начала года индекс MRSVT вырос на 8,7%, значительно опередив индексы MCFTR и MRBCTR, которые выросли с начала года на 1,2% и 3,3% соответственно.

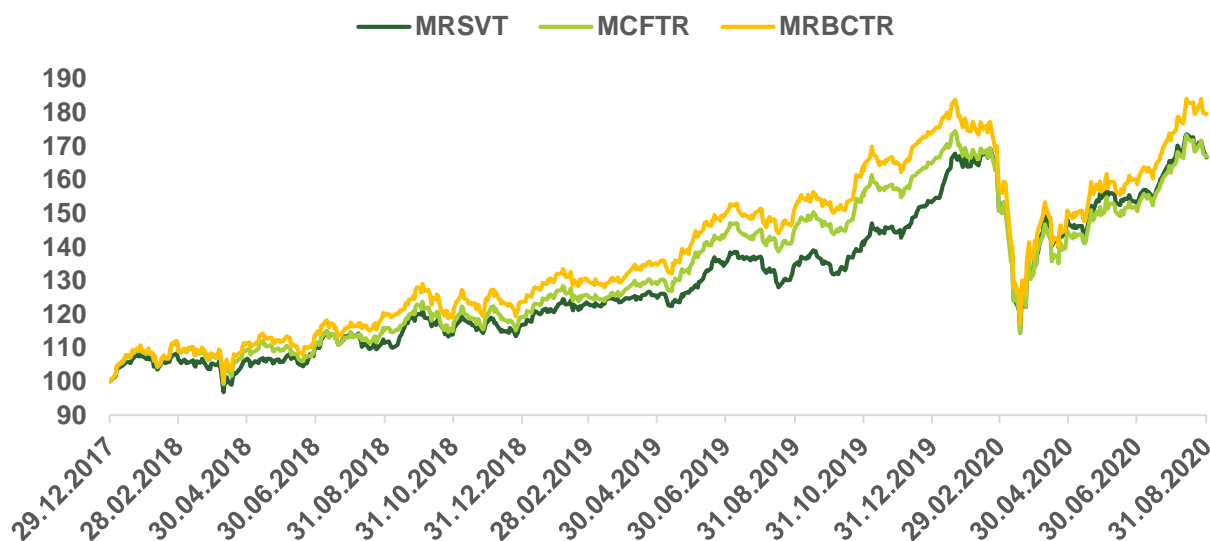
Состав MRSVT



Состав MCFTR



По состоянию на 29.05.20



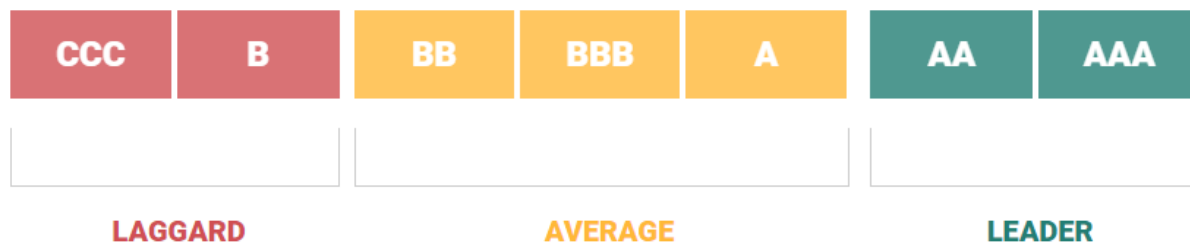
Изм.	MRSVT	MCFTR	MRBCTR
с 29.12.2017	66,6%	66,9%	79,6%
1 год	23,6%	14,9%	18,6%
YTD	8,7%	1,2%	3,3%

По состоянию на 31.08.20

Источники: Московская Биржа, РСХБ УК, расчёты РСХБ

ESGR ETFБрокерское обслуживание в АО «Россельхозбанк»
<https://www.rshb.ru/stock/broker-service/>

Тикер	Вес в MRSVT (29.05.20) *	Вес в MCFTR (29.05.20)	Полный доход YTD	Ценовая дох-ть ¹	Дивиденд ная дох-ть след 12 мес. ²	MSCI ESG RATING
GMKN	6,99%	8,32%	6,7%	30,8%	8,3%	B
IRAO	6,99%	1,46%	8,9%	58,7%	3,8%	A
FEES	6,57%	0,36%	7,3%	11,0%	--	
ALRS	5,75%	1,42%	-17,4%	17,9%	2,5%	BB
NLMK	5,26%	1,35%	18,6%	-17,2%	9,2%	BBB
RSTI	4,88%	--	13,3%	-15,0%	--	
RTKM	4,88%	0,53%	30,5%	4,4%	6,2%	
LKOH	4,81%	12,50%	-13,7%	38,2%	2,3%	BBB
PLZL	4,81%	2,83%	158,2%	6,9%	3,1%	A
CHMF	4,43%	1,35%	5,9%	5,6%	7,5%	CCC
MAGN	4,32%	0,62%	-1,7%	30,3%	18,8%	B
MTSS	4,32%	2,47%	16,1%	12,3%	9,1%	BB
TATN	4,24%	3,19%	-27,9%	41,4%	14,1%	BB
SBER	4,13%	13,00%	-10,9%	20,3%	8,2%	BB
ROSN	4,06%	3,77%	-12,9%	24,7%	2,7%	BB
RUAL	4,06%	0,58%	1,9%	32,1%	--	
PHOR	3,94%	0,78%	20,1%	-6,4%	4,6%	BBB
TRMK	3,94%	--	1,0%	-2,2%	--	
AFKS	3,87%	0,42%	39,5%	1,3%	--	
GAZP	3,87%	15,00%	-22,1%	33,8%	5,4%	BBB
NVTK	3,87%	5,05%	-11,2%	21,5%	2,2%	BBB

¹ (Консенсус-прогноз цены через 12 мес./Текущая цена-1)*100² (Прогноз дивидендов на след. 12 мес./Текущая цена)*100**Методология MSCI ESG Rating**

В России принципы ответственного инвестирования стали развиваться относительно недавно. Большинство российских компаний имеют средний уровень ESG рейтинга по международной классификации.

Веса в индексе MRSVT распределены более равномерно. Доля 3-х компаний с наибольшими весами в индексе MRSVT составляет 20,5%, в то время как, доля 3-х компаний с наибольшими весами в индексе МосБиржи – 40,5%.

* Указаны веса акций в Индексе МосБиржи - "PCPP Вектор устойчивого развития", полной доходности брутто (MRSVT). Точный состав фонда ESGR ETF не раскрывается – веса акций в фонде могут отличаться от весов в индексе MRSVT.

Источники: Московская Биржа, MSCI, расчёты РСХБ

НЕ ЯВЛЯЕТСЯ ИНВЕСТИЦИОННОЙ РЕКОМЕНДАЦИЕЙ

ESGR ETF

Брокерское обслуживание в АО «Россельхозбанк»
<https://www.rshb.ru/stock/broker-service/>

АО «Россельхозбанк»

Генеральная лицензия на осуществление банковских операций № 3349 (выдана Банком России 12.08.2015)
Лицензия на осуществление брокерской деятельности (выдана Федеральной службой по финансовым рынкам от 19.05.2005 №077-08455-100000)

Представленные в настоящем документе сведения носят исключительно информационный характер, оценки и мнения выражены с учетом ситуации на дату публикации документа. Настоящий документ не является предложением по покупке либо продаже финансовых инструментов и не должен рассматриваться как рекомендация к действиям.

Представленная информация не может рассматриваться в качестве гарантий или обещания будущей доходности вложений. Представленная информация, мнения и оценки подготовлены на основе публичных источников, которые рассматриваются Банком как надежные. Однако за достоверность предоставленной информации АО «Россельхозбанк» ответственности не несет. Информация и мнения, содержащиеся в настоящем документе, если прямо не указано иное, представлены АО «Россельхозбанк» на соответствующую дату. Банк оставляет за собой право по своему усмотрению без предварительного уведомления клиентов изменять либо не актуализировать информацию и мнения, содержащиеся в данном документе. Клиентам не следует полагаться исключительно на содержание данного документа в ущерб проведению собственного анализа. Банк, его аффилированные лица и сотрудники не несут ответственности за использование данной информации, за прямой или косвенный ущерб, наступивший вследствие использования представленной в настоящем документе информации, а также за ее достоверность. Банк не дает гарантий или заверений и не принимает какой-либо ответственности в отношении финансовых результатов, полученных на основании использования информации, содержащейся в настоящем документе. Стоимость инвестиций может как уменьшаться, так и увеличиваться, и клиент может в конечном счете не получить первоначально инвестированную сумму. АО «Россельхозбанк» не несет ответственности перед клиентом за финансовые потери, являющиеся результатом изменения рыночных котировок, изменения курса валют, дефолта эмитента ценных бумаг и иных рыночных факторов.

АО «Россельхозбанк» не осуществляет деятельность по инвестиционному консультированию, не является инвестиционным советником и не предоставляет индивидуальных инвестиционных рекомендаций в рамках Федерального закона от 22.04.1996 № 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг». Финансовые инструменты либо операции, упомянутые в документе, могут не соответствовать инвестиционному профилю клиента и его инвестиционным целям (ожиданиям). Определение соответствия финансового инструмента либо операции интересам клиента, инвестиционным целям, инвестиционному горизонту и уровню допустимого риска является задачей клиента. Банк не несет ответственности за возможные убытки в случае совершения операций либо инвестирования в финансовые инструменты, упомянутые в данном документе, и не рекомендует использовать указанную информацию в качестве единственного источника информации при принятии инвестиционного решения.

Средства, инвестированные в рамках заключенных с Банком соглашений об оказании брокерских услуг и/или соглашений об оказании брокерских услуг с использованием индивидуального инвестиционного счета, не застрахованы в соответствии с Федеральным законом «О страховании вкладов в банках Российской Федерации» от 23.12.2003 № 177-ФЗ.

Клиент должен учитывать возможные риски, сопряженные с осуществлением операций на финансовых рынках. Все основные риски описаны в Приложениях 12.1 -12.4 к Регламенту оказания брокерских услуг АО «Россельхозбанк» № 15-Р, с которыми можно ознакомиться на официальном сайте Банка по адресу www.rshb.ru в разделе «Брокерское обслуживание». До совершения сделок с финансовыми инструментами клиентам следует ознакомиться с указанными документами, описывающими основные риски при инвестициях на финансовом рынке.

Всю информацию об условиях предоставления продуктов и услуг Банка, а также о тарифах клиент может получить на официальном сайте Банка по адресу www.rshb.ru, а также в офисах Банка.

Настоящим АО «Россельхозбанк» информирует о возможном наличии конфликта интересов при предложении упомянутых в документе продуктов, услуг, финансовых инструментов, который может возникать ввиду совмещения Банком различных видов профессиональной деятельности на финансовых рынках, а также тем, что Банк является эмитентом ценных бумаг. При урегулировании возникающих конфликтов интересов Банк руководствуется интересами своих клиентов.

Все права на представленную информацию принадлежат АО «Россельхозбанк». Данная информация не может воспроизводиться, передаваться и распространяться без предварительного письменного разрешения АО «Россельхозбанк».