

Инструменты	Периоды	2003 - 2023 гг.																	5 лет			10 лет			21 год														
		дек. 2002	2003	2004	2005	2006	2007	2008	2009	2010	2011	2012	2013	дек. 2013	2014	2015	2016	2017	2018	дек. 2018	2019	дек. 2019	2020	дек. 2020	2021	дек. 2021	2022	дек. 2022	2023	дек. 2023	риск St.D	доход % год.	рост раз.	дек. 2023	риск St.D	доход % год.	рост раз.	дек. 2023	риск St.D
Индекс МосБиржи	—●—	319	61,4%	7,3%	83,1%	67,5%	11,5%	-67,2%	121,1%	23,2%	-16,9%	5,2%	2,0%	1504	-7,1%	26,1%	26,8%	-5,5%	12,3%	2369	28,6%	3046	8,0%	3289	15,1%	3787	-43,1%	2154	43,9%	3099	29%	5,5%	1,31	23%	7,5%	2,06	40%	11,4%	9,72
Индекс МосБиржи 10	—●—	585	72,7%	5,9%	62,5%	91,5%	0,9%	-63,2%	153,7%	25,4%	-18,3%	5,6%	-3,8%	3266	-6,9%	30,3%	24,2%	-16,2%	1,6%	4187	27,6%	5344	0,6%	5377	8,3%	5822	-30,6%	4039	46,8%	5930	26%	7,2%	1,42	22%	6,1%	1,82	46%	11,7%	10,15
Фонд рос. акций *	—●—	1852	40,8%	19,5%	87,8%	47,8%	9,3%	-71,0%	137,8%	26,8%	-26,8%	7,3%	5,6%	6844	-19,6%	37,6%	27,3%	-3,5%	11,4%	10364	35,7%	14064	6,8%	15023	14,0%	17126	-40,6%	10173	60,6%	16333	34%	9,5%	1,58	28%	9,1%	2,39	43%	10,9%	8,82
Фонд рос. облигаций **	—●—	7569	21,0%	13,5%	13,7%	8,1%	7,9%	-29,5%	61,2%	17,1%	8,5%	12,0%	5,1%	23456	-21,4%	35,1%	13,3%	11,6%	2,7%	32361	14,1%	36928	8,4%	40017	-1,4%	39455	1,9%	40206	9,5%	44027	6%	6,4%	1,36	14%	6,5%	1,88	17%	8,7%	5,82
Золото, Банк России, гр.	—●—	348,5	12,8%	-1,1%	21,5%	13,4%	22,3%	25,5%	29,3%	30,2%	17,8%	-0,7%	-22,1%	1262	70,1%	16,6%	-9,7%	6,2%	19,0%	2857	5,3%	3008	48,2%	4459	-3,6%	4298	-4,6%	4102	46,1%	5993	24%	16,0%	2,10	25%	16,9%	4,75	21%	14,5%	17,20
Серебро, Банк России, гр.	—●—	4,39	24,8%	8,0%	36,5%	31,8%	7,1%	-9,6%	64,1%	76,1%	-9,2%	8,7%	-29,9%	20,63	40,3%	12,8%	-4,0%	-1,0%	10,2%	34,16	3,9%	35,48	75,1%	62,11	-12,2%	54,54	-1,1%	53,95	29,6%	69,94	31%	15,4%	2,05	25%	13,0%	3,39	28%	14,1%	15,93
Доллар США	—●—	31,78	-7,3%	-5,8%	3,7%	-8,5%	-6,8%	19,7%	2,9%	0,8%	5,6%	-5,7%	7,8%	32,73	71,9%	29,5%	-16,8%	-5,0%	20,6%	69,47	-10,9%	61,91	19,3%	73,88	0,6%	74,29	-5,3%	70,34	27,5%	89,69	15%	5,2%	1,29	25%	10,6%	2,74	19%	5,1%	2,82
Евро	—●—	33,11	11,2%	2,7%	-9,6%	1,5%	3,6%	15,3%	7,1%	-9,1%	3,3%	-3,5%	11,8%	44,97	52,0%	16,6%	-19,9%	7,9%	15,4%	79,46	-12,7%	69,34	30,8%	90,68	-7,3%	84,07	-10,0%	75,66	31,1%	99,19	20%	4,5%	1,25	22%	8,2%	2,21	17%	5,4%	3,00
Жильё в Москве, тыс.р./м²	—●—	33,9	28,5%	15,0%	31,7%	68,2%	-1,7%	45,5%	-25,2%	16,5%	16,4%	0,4%	3,3%	166,7	17,3%	-6,0%	-8,9%	-2,5%	5,5%	172,3	3,6%	178,5	16,2%	207,5	18,5%	245,8	2,3%	251,4	7,6%	270,4	7%	9,4%	1,57	9%	5,0%	1,62	20%	10,4%	7,99
Индекс гос. облигаций	—●—	100,0	31,6%	7,8%	12,2%	6,3%	7,8%	-7,6%	41,6%	8,5%	7,2%	14,3%	0,6%	319,3	-12,7%	28,0%	15,9%	12,8%	2,1%	476,4	20,0%	571,6	8,5%	620,5	-4,9%	589,8	3,7%	611,7	0,8%	616,4	8%	5,3%	1,29	12%	6,8%	1,93	13%	9,0%	6,16
Индекс корп. облигаций ***	—●—	27,0	18,1%	6,5%	7,1%	9,0%	6,5%	-11,7%	23,7%	13,9%	6,2%	8,6%	8,8%	65,8	-1,4%	18,8%	10,8%	12,3%	4,4%	100,0	16,5%	116,5	10,1%	128,3	0,2%	128,6	9,5%	140,8	3,2%	145,3	6%	7,8%	1,45	6%	8,3%	2,21	7%	8,4%	5,39
Портфель лежебоки	—●—	100,0	24,9%	10,6%	41,0%	23,1%	13,2%	-25,0%	76,1%	24,7%	-0,2%	6,2%	-3,8%	455,9	9,7%	29,8%	10,3%	4,8%	11,0%	832,6	18,4%	985,6	21,1%	1193,9	3,0%	1229,6	-14,4%	1052,3	38,7%	1459,8	18%	11,9%	1,75	14%	12,3%	3,20	21%	13,6%	14,60
Инфляция, Росстат	—●—	100,0	12,0%	11,7%	10,9%	9,0%	11,9%	13,3%	8,8%	8,8%	6,1%	6,6%	6,5%	273,4	11,4%	12,9%	5,4%	2,5%	4,3%	387,4	3,0%	399,1	4,9%	418,6	8,4%	453,7	11,9%	507,9	7,4%	545,6	3%	7,1%	1,41	4%	7,2%	2,00	3%	8,4%	5,46
Индекс S&P 500 в рублях	—●—	28,0	17,1%	2,7%	6,8%	3,9%	-3,5%	-26,4%	28,4%	12,5%	5,6%	7,0%	39,7%	60,5	91,5%	28,6%	-8,8%	13,6%	11,9%	172,7	15,8%	200,0	38,7%	277,5	27,6%	354,1	-23,7%	270,1	58,4%	427,8	27%	19,9%	2,48	31%	21,6%	7,07	26%	13,9%	15,30
Депозиты руб. до 1 года	—●—	100,0	11,5%	9,7%	9,1%	8,2%	7,5%	7,9%	10,9%	7,0%	5,6%	6,7%	6,7%	239,2	6,9%	10,1%	7,4%	6,2%	5,6%	339,3	5,6%	358,3	3,9%	372,3	3,9%	386,7	8,0%	417,5	7,9%	429,2	2%	4,8%	1,26	2%	6,0%	1,79	2%	7,2%	4,29

* Фонд рос. акций - бывш. "Добрыня Никитич"; ** Фонд рос. облигаций - бывш. "Илья Муромец", УК "Первая", ранее УК Сбер, ранее УК "Тройка-Диалог"; *** Индекс корп. облигаций - RUCBITR до 31.12.2008 и RUCBTRNS после

2003 2004 2005 2006 2007 2008 2009 2010 2011 2012 2013 2014 2015 2016 2017 2018 2019 2020 2021 2022 2023 2024

