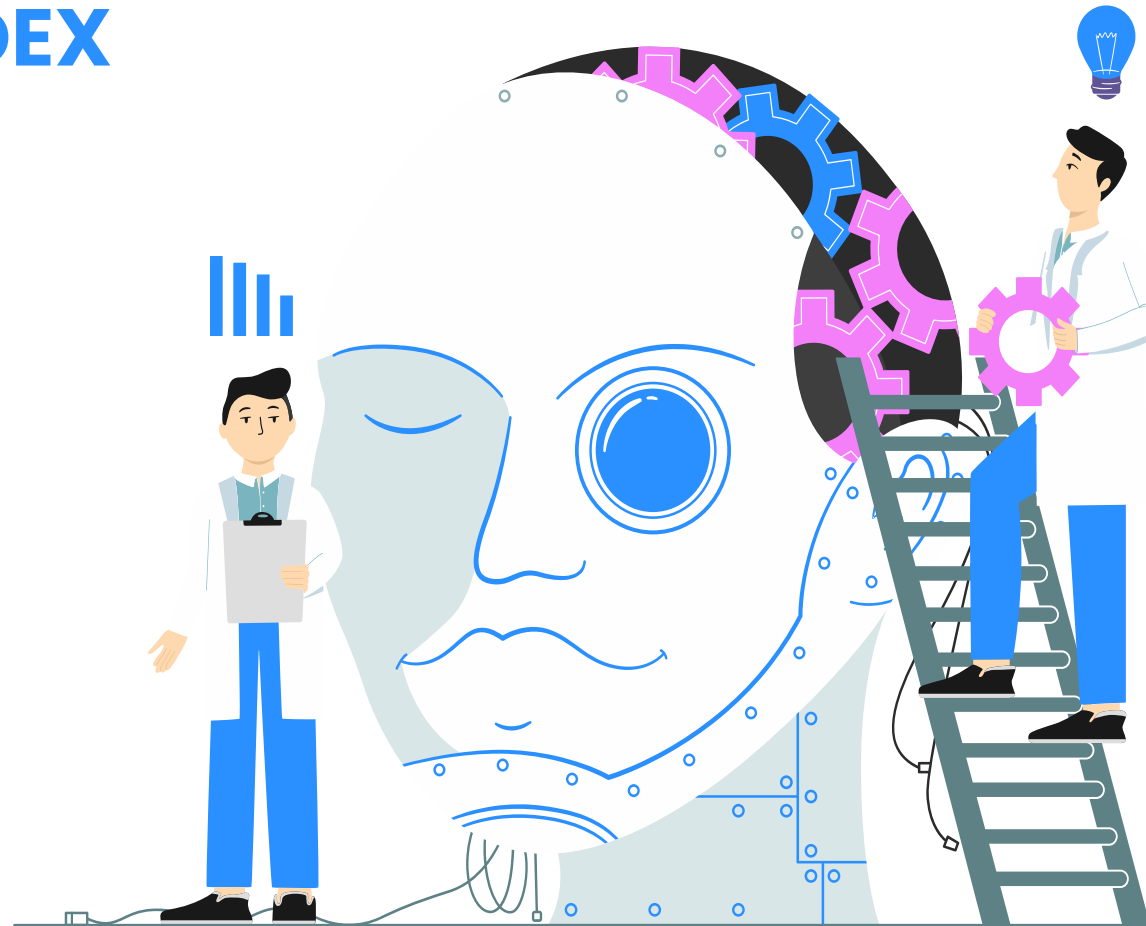


META REALITY INDEX
BFTMVR Index



Что такое Метаверсия или Мета Реальность?

1. Метаверсия лучше всего понимать как квази-дополнительное состояние Интернета. Подобно тому, как мобильный Интернет расширил возможность кабельного Интернета 1990-х и 2000-х метаверсия расширяет применение интернета в целом.
2. Метаверсия будет состоять из бесчисленных постоянных виртуальных миров, которые взаимодействуют друг с другом, а также с реальным миром. Будет создана прочная экономическая связь, охватывающую рутинную жизнь каждого человека.
3. Трансформируя уже наступает через умные колонки, социальные сети, виртуальные выставки и коммуникации, искусство, погружение в виртуальные миры. При этом давно существующие отрасли, такие как финансы и банковское дело, розничная торговля и образование, здоровье и фитнес, и многое другое приобретут свое место в Мета мире.



Приставка "мета" прибавляет к "реализму" то, что сам он вычитает из всеобъемлющей Реальности, сводя к одному из ее подвидов

М.Эпштейн "Поколение, нашедшее себя"

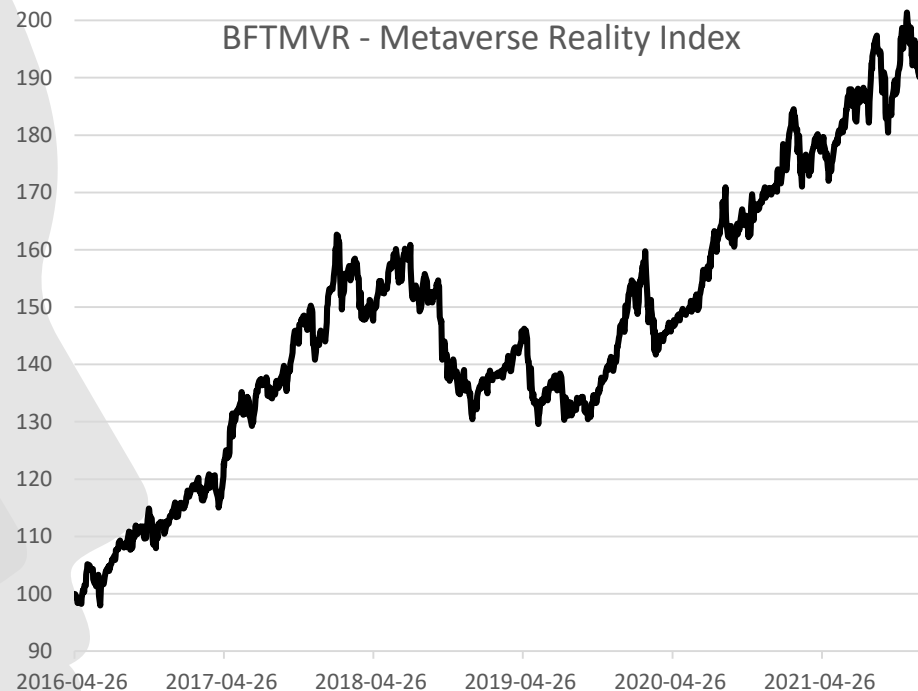
СЕКТОРА – «Мета реальность»

- **Расчетная инфраструктура** – компании которые предоставляют облачные решения для хранения и обработки больших массивов информации Мета миров
- **Коммуникационные сети** – компании телекоммуникационного и высокоскоростного дата трафика
- **Виртуальные платформы** – компании создающие мета миры через социальные сети, онлайн игры где участники могут коммуницировать друг с другом и вступать в различные экономические и личные отношения
- **Производители плат и чипов** – крупнейшие производители микроэлектроники, на основе которых будут создана инфраструктура для мета миров
- **Безопасность** – лидирующие в мире компании занимающиеся кибербезопасностью
- **Разработчики новых протоколов** – компании, которые создавая новые форматы протоколов будут позволять стандартным услугам и отношениям проникнуть в мета миры, в том числе финансовым отношения

Индекс Мета Реальности - BFTMVR Index

Два основных фактора изменивших жизнь населения создали предпосылки для нового витка развития интернета – **МЕТАВЕРСИЯ**

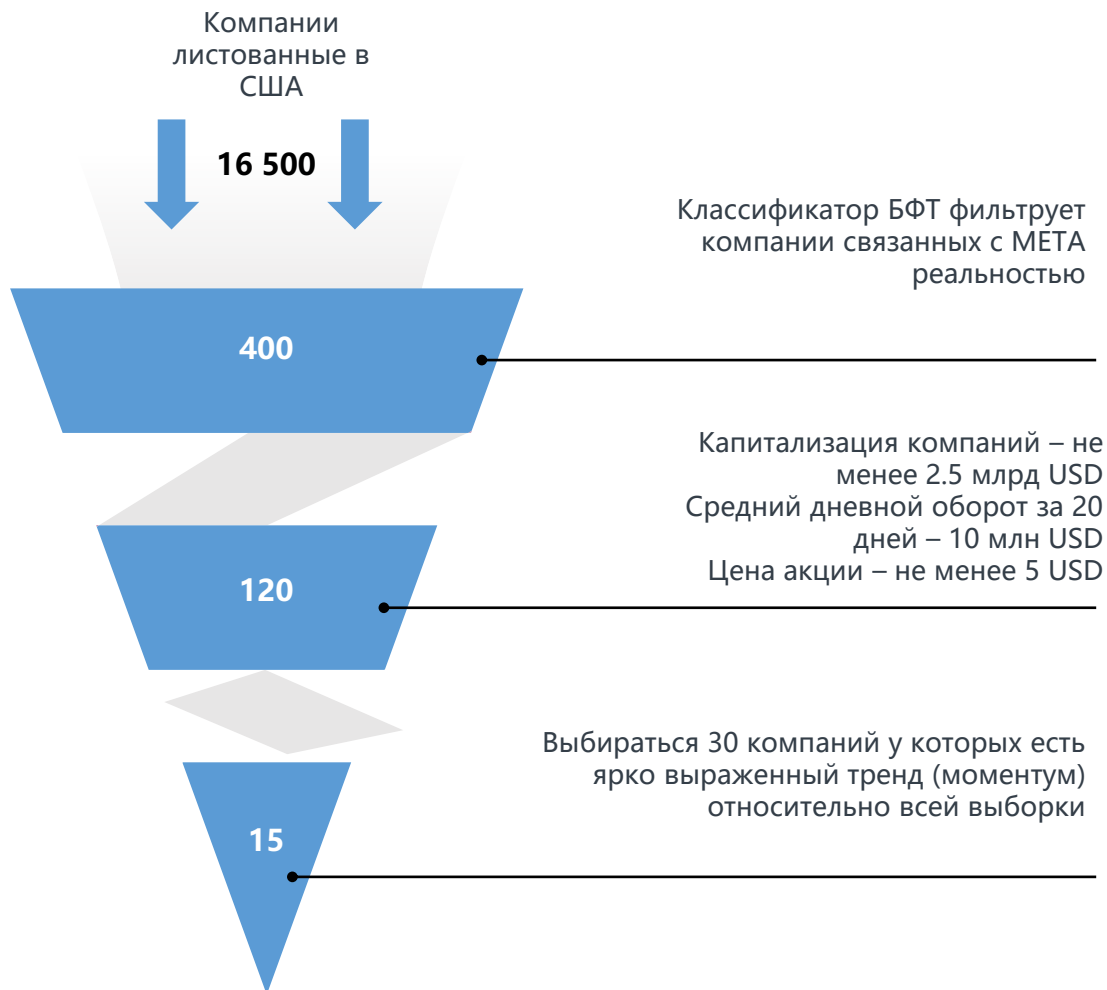
1. Рост уровня жизни и высокая социальная поддержка населения
2. Проникновение технологического сектора в большинство традиционных отраслей, финансы, транспорт, развлечения, торговля и коммуникации, создало предпосылки для за последние 10 лет



*По данным Bloomberg Intelligence от 4/07/2021

Доходность					Ежегодная доходность				
	YTD	1Y	3Y	5y	Max просадка	YTD	1Y	3Y	5y
	-1.31%	11.0%	46.2%	90.3%	-15,89%		11.0%	12.1%	10.8%
Волатильность					Шарп				
	YTD	1Y	3Y	5y	YTD	1Y	3Y	5y	
	9.60%	13.21%	12.85%	12.23%		0.84	0.98	0.86	

Ежеквартальный отбор лучших акций

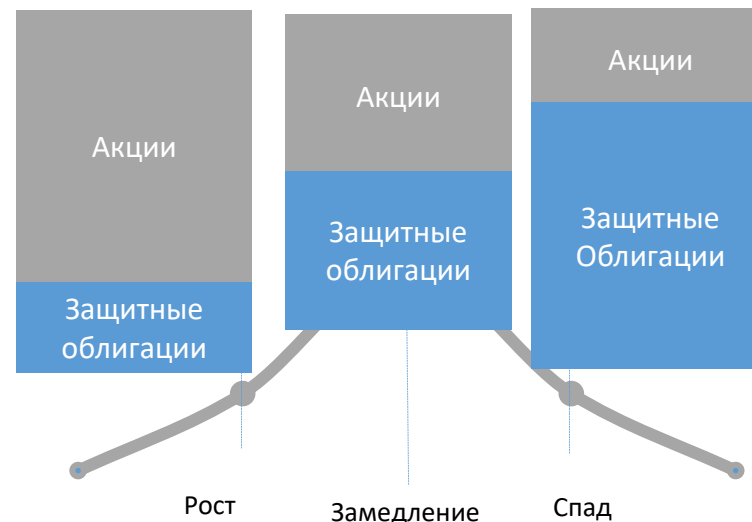


Непрерывное управление рисками

“Вся жизнь — управление рисками, а не исключение рисков”

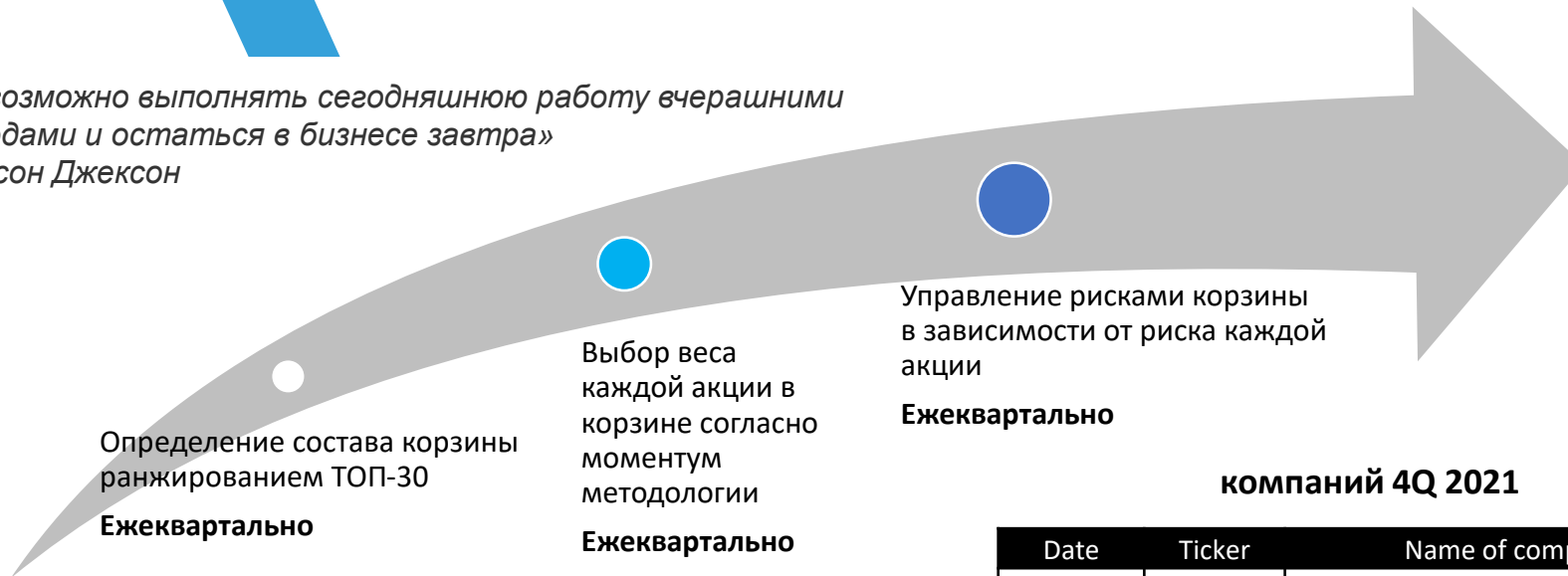
— Уолтер Ристон, бывший глава Citicorp

Таргетирование волатильности на уровне 13%



Построение стратегии

«Не возможно выполнять сегодняшнюю работу вчерашними методами и остаться в бизнесе завтра»
Нельсон Джексон



Определение состава корзины ранжированием ТОП-30
Ежеквартально

Выбор веса каждой акции в корзине согласно моментум методологии
Ежеквартально

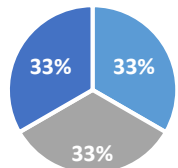
Управление рисками корзины в зависимости от риска каждой акции
Ежеквартально

компаний 4Q 2021

Date	Ticker	Name of company
2021-10-21	AMD UW	AMD
2021-10-21	BIDU UW	Baidu
2021-10-21	FB UW	Meta
2021-10-21	GME UN	GameStop Corp
2021-10-21	GOOG UW	Alphabet
2021-10-21	IT UN	Gartner Inc
2021-10-21	MSFT UW	Microsoft
2021-10-21	NFLX UW	Netflix
2021-10-21	NVDA UW	NVIDIA
2021-10-21	RBLX UN	Roblox Corporation
2021-10-21	SNAP UN	Snap Chat
2021-10-21	SONY UN	Sony
2021-10-21	TRI UN	Thomson Reuters Corporation (TRI)
2021-10-21	TSM UN	Taiwan Semiconductor
2021-10-21	TWTR UN	Twitter

Риск паритетное взвешивание

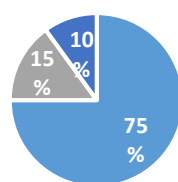
Взвешивание



Традиционное



вклад в риск портфеля



Моментум

