Integrum CEEMEA USD Bond Fund

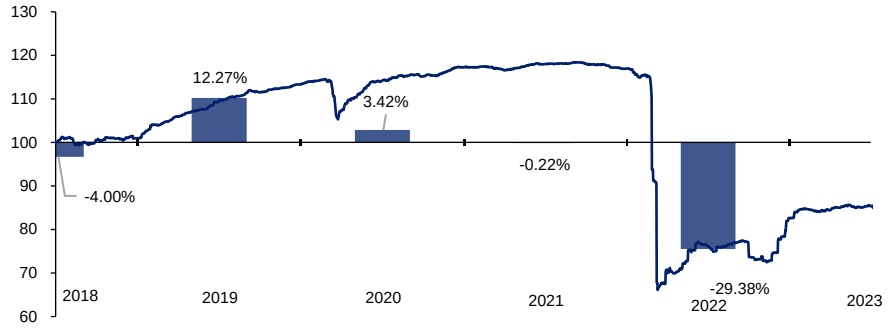
Данные на 30.06.2023

INTEGRUM

Политика вложений

Целью вложений фонда облигаций является достижение долгосрочного прироста капитала путем вложения средств фонда в долговые ценные бумаги, эмитированные или гарантированные центральными банками, правительствами, муниципалитетами, коммерческими компаниями и кредитными учреждениями, зарегистрированными в странах Центральной и Восточной Европы, Ближнего Востока и Центральной Азии.

Доходность по годам и стоимость инвестиций в размере 100 USD (30.06.2018 - 30.06.2023)



Основная информация фонда

Категория фонда	Фонд корпоративных облигаций
ISIN	LV0000400331
Bloomberg ticker	ABLVHYU LR
Валюта фонда	USD
Дата создания	28.06.2007
Страна регистрации	Латвия
Аудитор	AS “Nexia Audit Advice”
Управляющее общество	Integrum Asset Management IPAS
Управляющий	Сергей Гаченко
Минимальное вложение	1 000 USD
Распределение доходов	Реинвестирование
Комиссия за покупку	1.00%
Комиссия за управление	1.75% в год

Профиль риска[1]

Общая доходнось

С начала года	3.34%
1 месяц	0.34%
3 месяца	1.05%
1 год	11.98%
3 года	-25.24%
5 лет	-14.63%
С момента создания (годовая)	2.24%

10 крупнейших позиций

	Доля
US GOVT NATIONAL 0.000 28/09/2023	9.49%
US GOVT NATIONAL 0.250 31/10/2025	6.25%
KAZMUNAYGAZ NATIONAL CO 4.750 19/04/2027	4.59%
REPUBLIC OF TAJIKISTAN 7.125 14/09/2027	3.61%
NATIONAL BANK FOR FOREIGN ECONOMIC 4.850 21/10/2025	2.75%
REPUBLIC OF HUNGARY 6.125 22/05/2028	2.51%
REPUBLIC OF HUNGARY 6.250 22/09/2032	2.50%
INTERGAZ CENTRAL ASIA 4.375 26/09/2027	2.28%
ROMANIA 6.625 17/02/2028	2.04%
SAUDI ARABIA, KINGDOM OF 5.500 25/10/2032	2.03%

Характеристики фонда

Нетто активы фонда	10 381 342 USD
Стоимость доли фонда	14.26 USD
Средний рейтинг***	A-
Доходность к погашению**	5.90%
Текущая доходность**	3.67%
Средний срок до погашения (лет)	4.13
Модифицированная дюрация**	3.33
Волатильность (годовая)*	15.64%
Коэффициент Шарпа*	-0.22
Максимальное падение стоимости доли*	-44.22%
Количество позиций	51

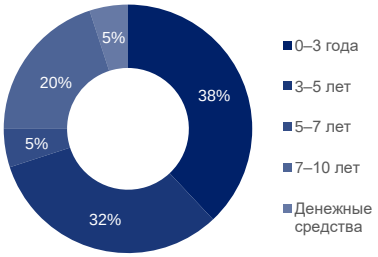
**За последние 5 лет*

***Без учета позиций России и Украины*

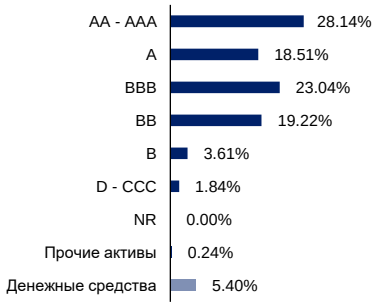
****Без учета позиций России*

Структура по странам (10 основных)

Структура по срокам погашения



Структура кредитных рейтингов



[1]Синтетический показатель Фонда ориентировочно отображает возможное колебание стоимости доли Фонда. Более подробную информацию см. в документе «Предназначенная для вкладчиков основная информация».

Исторические результаты не являются гарантией будущих результатов фонда. Настоящий материал носит информационный характер и не может считаться предложением или рекомендацией купить или продать упомянутые в нем удостоверения вложений.

Общую информацию об инвестиционных фондах Integrum и управляющем обществе Integrum Asset Management IPAS, а также дополнительную информацию можно найти на нашем сайте: https://www.integrum.lv/ru/fondi/