ABLV Global Corporate USD Bond Fund

Данные на 30.09.2022

INTEGRUM

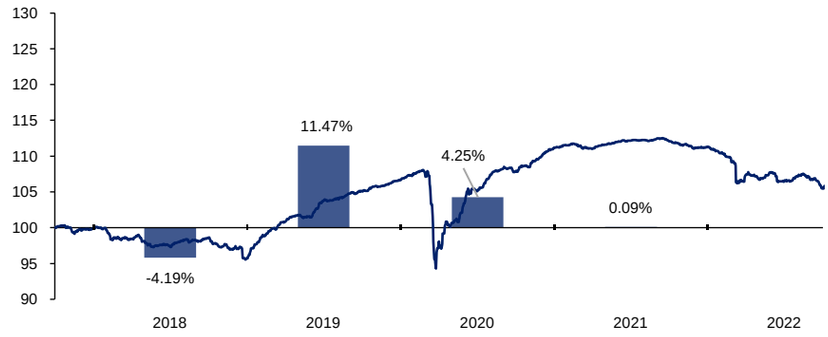
Политика вложений

Целью вложений фонда корпоративных облигаций является достижение долгосрочного прироста капитала путем вложения средств фонда в долговые ценные бумаги, эмитированные или гарантированные коммерческими обществами или кредитными учреждениями, зарегистрированными в странах глобального рынка облигаций в USD.

Основная информация фонда

Категория фонда	Фонд корпоративных облигаций
ISIN	LV0000400802
Bloomberg ticker	ABLVGCU LR
Валюта фонда	USD
Дата создания	05.06.2013
Страна регистрации	Латвия
Аудитор	SIA “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

Доходность по годам и стоимость инвестиций в размере 100 USD (30.09.2017 - 30.09.2022)



Профиль риска[1]

Общая доходность

С начала года	-5.24%
1 месяц	-1.21%
3 месяца	-0.91%
1 год	-5.89%
3 года	0.36%
5 лет	5.47%
С момента создания (годовая)	1.98%

10 крупнейших позиций

	Доля
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 5.250 01/03/2026	1.90%
MORGAN STANLEY 3.875 27/01/2026	1.86%
JPMORGAN CHASE AND CO 3.200 15/06/2026	1.82%
HCA HEALTHCARE INC 5.250 15/04/2025	1.67%
PITNEY BOWES INC 4.625 15/03/2024	1.56%
CALATLANTIC GROUP INC 5.875 15/11/2024	1.42%
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV 5.250 15/04/2023	1.42%
AIRCASTLE LTD 5.000 01/04/2023	1.41%
ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS 5.875 01/11/2022	1.40%
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD 5.875 25/01/2023	1.39%

Характеристики фонда

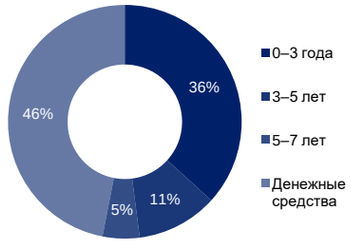
Нетто активы фонда	17982 720 USD
Стоимость доли фонда	12.01 USD
Средний рейтинг	BB+
Доходность к погашению**	7.47%
Текущая доходность**	2.64%
Средний срок до погашения (лет)	2.30
Модифицированная дюрация**	1.07
Волатильность (годовая)*	4.72%
Коэффициент Шарпа*	0.00
Максимальное падение стоимости доли*	-12.77%
Количество позиций	50

**За последние 5 лет*

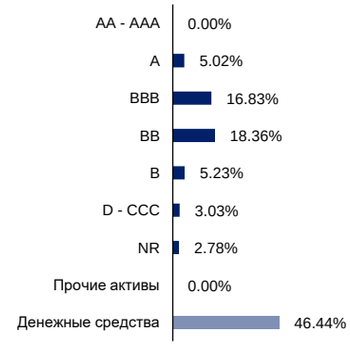
*** **Б**ез учета позиций России, Украины*

Распределение по отраслям

Структура по срокам погашения[2]



Структура кредитных рейтингов[2]



[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 ABLV и управляющем обществе Integrum Asset Management IPAS, а также дополнительную информацию можно найти на нашем сайте: https://www.ablv.com/lv/services/investments/mutual-funds

[2]Ценные бумаги ETF не включены