ABLV European Corporate EUR Bond Fund

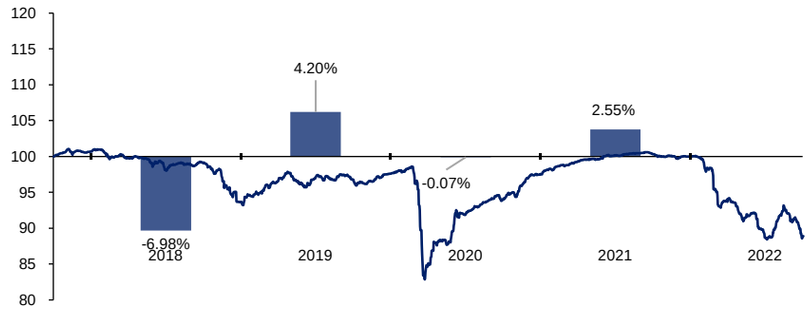
Данные на 30.09.2022

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 европейских странах.

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



Основная информация фонда

Категория фонда	Фонд корпоративных облигаций
ISIN	LV0000400810
Bloomberg ticker	ABLVECE LR
Валюта фонда	EUR
Дата создания	06.06.2013
Страна регистрации	Латвия
Аудитор	SIA “Nexia Audit Advice”
Управляющее общество	Integrum Asset Management IPAS
Управляющий	Сергей Гаченко
Минимальное вложение	1 000 EUR
Распределение доходов	Реинвестирование
Комиссия за покупку	1.00%
Комиссия за управление	1.25% в год

Профиль риска[1]

Общая доходнось

С начала года	-11.12%
1 месяц	-2.67%
3 месяца	0.23%
1 год	-11.40%
3 года	-8.12%
5 лет	-11.11%
С момента создания (годовая)	0.81%

10 крупнейших позиций

	Доля
INTRUM JUSTITIA AB 3.125 15/07/2024	5.75%
JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC 2.200 15/01/2024	5.60%
INEOS HOLDINGS LTD 2.125 15/11/2025	5.31%
LANDSBANKINN HF 1.750 20/05/2024	4.36%
GAZPROM PJSC 2.250 22/11/2024	3.39%
ADMIRAL MARKETS AS 8.000 28/12/2027	3.21%
NEXANS SA 2.750 05/04/2024	3.16%
UNIPOL GRUPPO SPA 3.500 29/11/2027	3.08%
LOXAM SAS 4.250 15/04/2024	3.05%
MAXIMA GROUP UAB 5.000 13/09/2023	3.04%

Характеристики фонда

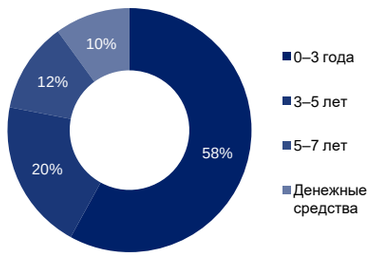
Нетто активы фонда	3174 811 EUR
Стоимость доли фонда	10.78 EUR
Средний рейтинг	BB-
Доходность к погашению**	9.47%
Текущая доходность**	3.32%
Средний срок до погашения (лет)	2.51
Модифицированная дюрация**	2.01
Волатильность (годовая)*	5.84%
Коэффициент Шарпа*	-0.31
Максимальное падение стоимости доли*	-17.97%
Количество позиций	31

**За последние 5 лет*

*** **Б**ез учета позиций России*

Распределение по отраслям

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 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