

## Инвестиционная цель

ITI Funds Russia-focused USD Eurobond ETF SICAV — это биржевой инвестиционный фонд, выпущенный по правилам UCITS, цель которого — достижение показателей, соответствующих индексу ITI Funds Russia-focused USD Eurobond Index (ITIEURBD). ETF предлагает уникальную возможность получить физический доступ к 15 российским еврооблигациям.

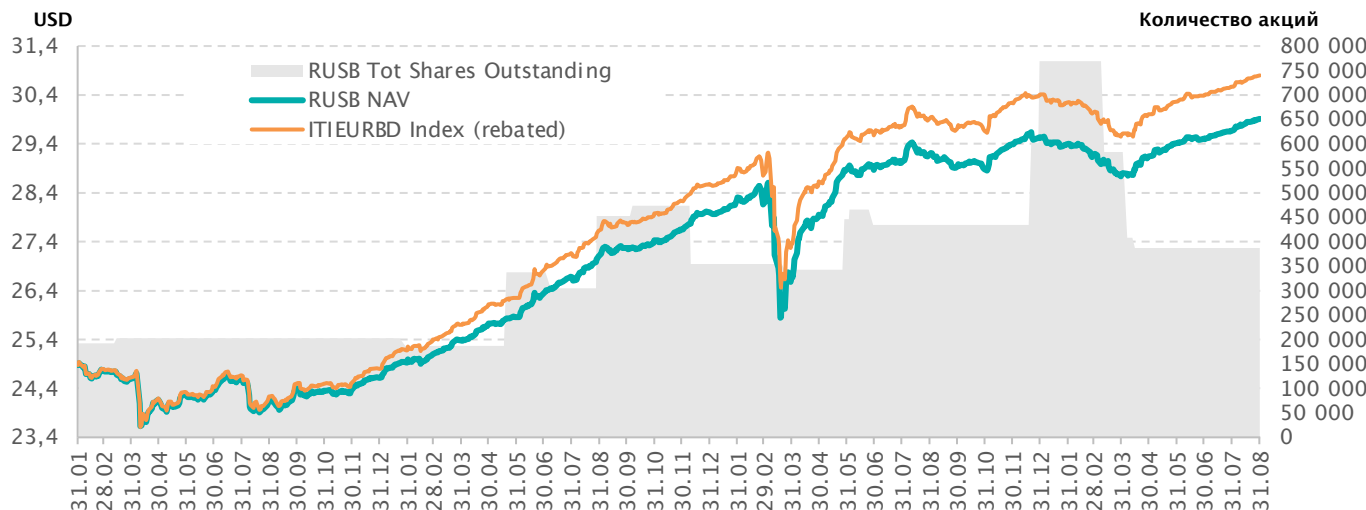
## Основные преимущества

- Возможность инвестировать в диверсифицированный портфель долларовых еврооблигаций российских эмитентов
- Доступ к бондам с рейтингом, на одну ступень ниже суверенного рейтинга России (Ba1/BB+)
- Эмитенты, находящиеся под действием санкций, исключены
- Расчеты в системе Euroclear
- Листинг на Лондонской и Московской фондовых биржах, Международной Бирже Астаны

## Ключевые данные

Число еврооблигаций в портфеле:	15	СЧА на акцию, USD:	29,9112
Средний купон:	5,14%	Кол-во размещенных акций:	387000
Доходность к погашению:	2,16%	Всего активов USD:	11 575 638,70
Дюрация (в годах):	5,29	Дата публикации СЧА:	31.08.2021
Средний рейтинг:	BBB-	Финансовый результат с 04.01.21:	1,24%
Самый низкий рейтинг:	BB+	Доходность индекса с 04.01.21:	1,28%
Доля Еврооблигаций ниже BBB-	18,64%	Непогашенная сумма USD	16 917 321 218

Тип фонда:	UCITS ETF
Класс активов:	Инструменты с фиксированной доходностью
Регион инвестирования:	Россия
ISIN:	LU1483649825
RIC:	RUSB.L / RUSB.MM
Bloomberg:	RUSB LN / RUSB RX
Биржи:	Лондон (LSE); Москва (MOEX)
Базовая валюта фонда:	USD
Базовый индекс:	ITIEURBD Index
Вид репликации:	Физическая
Использование дохода:	Капитализация
Ребалансировка:	Ежеквартально
Размер общей комиссии (TER)	0.50%
Место нахождения фонда	Люксембург
Кастодиан	Edmond de Rothschild (Europe)
Управляющая компания:	Fuchs Asset Mgmt.
Инвестиционный менеджер	Da Vinci Capital Mgmt.
Аудитор	KPMG



Источник: ITI Funds, Bloomberg по состоянию на 31.08.2021

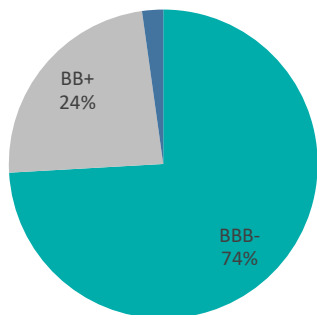


## 10 Крупнейших активов фонда

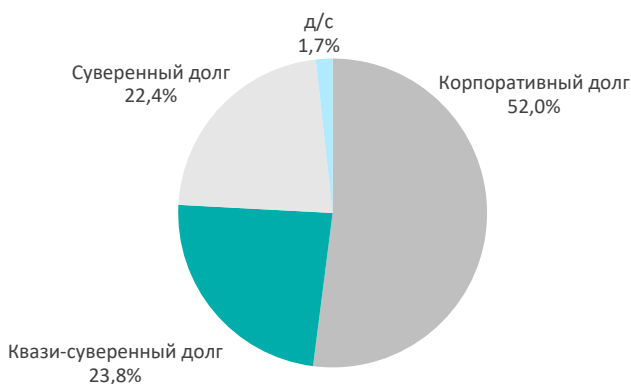
#	ISIN	Название ЦБ	Валюта	Страна	Вес	S&P	Moody's
1	XS0316524130	GAZPRU 7.288 08/16/37	USD	RU	9,69%	BBB-	Baa2
2	XS0767473852	RUSSIA 5 5/8 04/04/42	USD	RU	9,34%	BBB-	Baa3
3	XS0559915961	VEBBNK 6.8 11/22/25	USD	RU	8,31%	BBB-	
4	XS1843435337	NLMKRU 4.7 05/30/26	USD	RU	7,78%		Baa2
5	XS0971721963	RUSSIA 5 7/8 09/16/43	USD	RU	7,33%	BBB-	Baa3
6	XS2010044621	SIBUR 3.45 09/23/24	USD	RU	7,32%		Baa3
7	XS2010030919	ALRSRU 3.1 06/25/27	USD	RU	7,23%	BBB-	Baa2
8	XS0997544860	SIBNEF 6 11/27/23	USD	RU	5,81%	BBB-	Baa2
9	XS0971721450	RUSSIA 4 7/8 09/16/23	USD	RU	5,75%	BBB-	Baa3
10	XS1603335610	METINR 4.85 05/02/24	USD	RU	5,69%	BB+	Ba1

## Структура активов

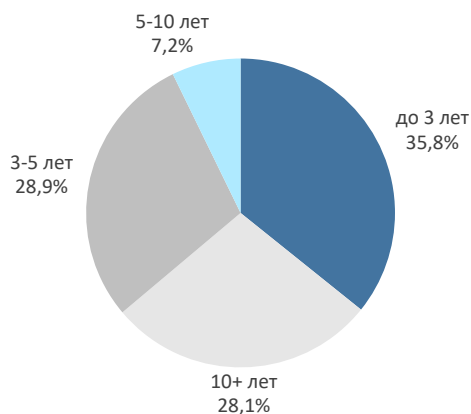
Рейтинг



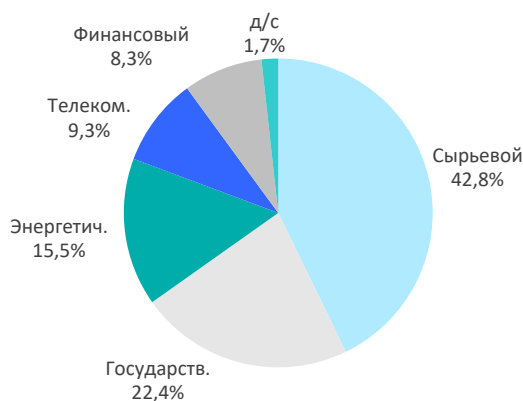
Тип эмитента



Срочность



Сектор



Источник: ITI Funds, Bloomberg по состоянию на 31.08.2021

## ОГРАНИЧЕНИЕ ОТВЕТСТВЕННОСТИ

Данные материалы не должны рассматриваться как предложение покупки или продажи ценных бумаг. Инвесторы и другие участники рынка ценных бумаг должны полагаться на собственные суждения и опыт при принятии решения об инвестировании в ценные бумаги. Материалы, представленные в данном разделе, носят исключительно информационный характер и основаны на информации из публичных источниках, которые рассматриваются достоверными. Ценные бумаги, описанные в данном разделе, могут не подлежать продаже во всех юрисдикциях или определенным категориям инвесторам. Стоимость инвестиций может как уменьшаться, так и увеличиваться, и инвесторы могут в конечном счете потерять первоначально инвестированную сумму. Цены инвестиционных инструментов и показатели доходности инвестиций в прошлом не могут служить ориентиром для оценки результатов инвестиций в будущем. Изменения курса иностранной валюты могут также вызвать уменьшение или увеличение стоимости инвестиций. Другие факторы риска, влияющие на стоимость инвестиций или на доход от инвестиций, включают, помимо прочего, политические, экономические, кредитные и рыночные риски. Перед принятием решений об инвестировании необходимо посоветоваться с инвестиционным консультантом. Информация, представленная в данном документе, не может быть воспроизведена, повторно распространена или опубликована полностью, или частично для любой цели без письменного разрешения компании. Ни компания, ни какое-либо её аффилированное лицо не несёт никакой ответственности за действия третьих лиц в этом отношении. Дополнительная информация и сопроводительная документация предоставляются по запросу.