

BOND ETF

ДОХОДЬ Сбондс Корпоративные облигации РФ

ПРЕИМУЩЕСТВА ДЛЯ ИНВЕСТОРОВ



Инвестиции в «средний» рынок облигаций

BOND ETF следует индексу Cbonds CBI RU Middle Market Investable, который отражает «средний» рынок наиболее ликвидных корпоративных облигаций российских эмитентов с кредитным качеством, расположенным между A+ до BB+ (включительно).

Фокус на этот рынок формирует потенциал получения повышенной доходности при относительно низких рисках.



Широкая диверсификация

Максимальный вес на одного эмитента при ребалансировке индекса составляет 4%, максимальный вес одной отрасли – 20%. Минимальное число бумаг – 30. Такая диверсификация эффективно снижает кредитный риск отдельных эмитентов без потери в доходности.



Низкие затраты и высокая ликвидность

Ориентация на высокую ликвидность облигаций позволяет снижать издержки при ребалансировках и потери на спредах. Поэтому максимальные затраты фонда составляют всего 0.4% в год.



ETF УК ДОХОДЬ

Базовые инвестиции

ОБЛИГАЦИИ

RUB

ДЕТАЛИ ФОНДА

12 января 2023

| | |
|-----------------------|------------------|
| ISIN | RU000A104Z22 |
| Код на МосБирже | BOND |
| Уровень листинга | первый уровень |
| СЧА | 141,7 млн.руб. |
| Число активов | 42 |
| Макс. затраты, в год | 0.4% |
| из них фиксированные | 0.39% |
| Распределение доходов | реинвестирование |

ДИНАМИКА ДОХОДНОСТИ (%)

| | 3 мес. | с начала года | 1 год | 3 года | с нач. торгов |
|---------------------------------|--------|---------------|-------|--------|---------------|
| BOND ETF (СЧА) | 4.92 | 0.36 | - | - | 6.22 |
| Бенчмарк | 5.28 | 0.3 | 13.85 | 29.98 | 6.61 |
| Индекс МосБиржи Корп. Облигаций | 2.2 | 0.24 | 8.48 | 16.92 | 2.98 |

ТОП 10 ИНВЕСТИЦИЙ

| Название | Доля, % | Название | Доля, % |
|--------------|---------|-------------------|---------|
| КИВИФ 1P01 | 4.24 | Аэрофл БО1 | 3.99 |
| ЦППК 1P-03 | 4.13 | Экспобанк-001P-01 | 3.98 |
| Новотр 1P1 | 4.12 | УрКаПБОБР | 3.97 |
| О'КЕЙ Б1P3 | 4.06 | ХКФБанк-4-606 | 3.88 |
| Камаз-БО-П10 | 4.01 | Боржоми1P1 | 3.82 |

СТРУКТУРА ПО ОТРАСЛЯМ



ХАРАКТЕРИСТИКИ БЕНЧМАРКА

| | | | |
|----------------------------|------|---------------------------|-------|
| Доходность к погаш. УТМ, % | 11,6 | Бета к индексу акций | 0.14 |
| Дюрация, дней | 548 | Стандартное отклонение, % | 5.71 |
| G-Spread, пункты | 388 | Мах просадка | 15.52 |
| | | Лучший месяц, % | 8.37 |
| Уровень риска | | Худший месяц, % | -7.93 |

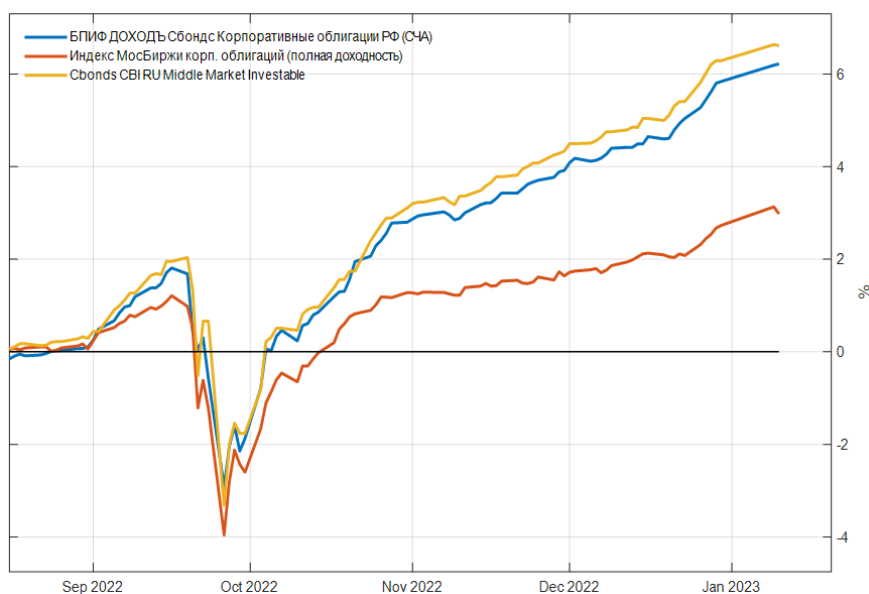
ДОПОЛНИТЕЛЬНЫЕ ПОКАЗАТЕЛИ ДОХОДНОСТИ

ДОХОДНОСТЬ В % ГОДОВЫХ

| | 1Y | 3Y | 5Y | 7Y | 10Y | с нач. торгов |
|---------------------------------|-------|------|----|----|-----|---------------|
| BOND ETF (СЧА) | - | - | - | - | - | - |
| Бенчмарк | 13.89 | 9.15 | - | - | - | - |
| Индекс МосБиржи Корп. Облигаций | 8.51 | 5.36 | - | - | - | - |

Не рассчитывается для инструментов, тогующихся менее одного года

ДИНАМИКА НАКОПЛЕННОЙ ДОХОДНОСТИ ФОНДА (%)

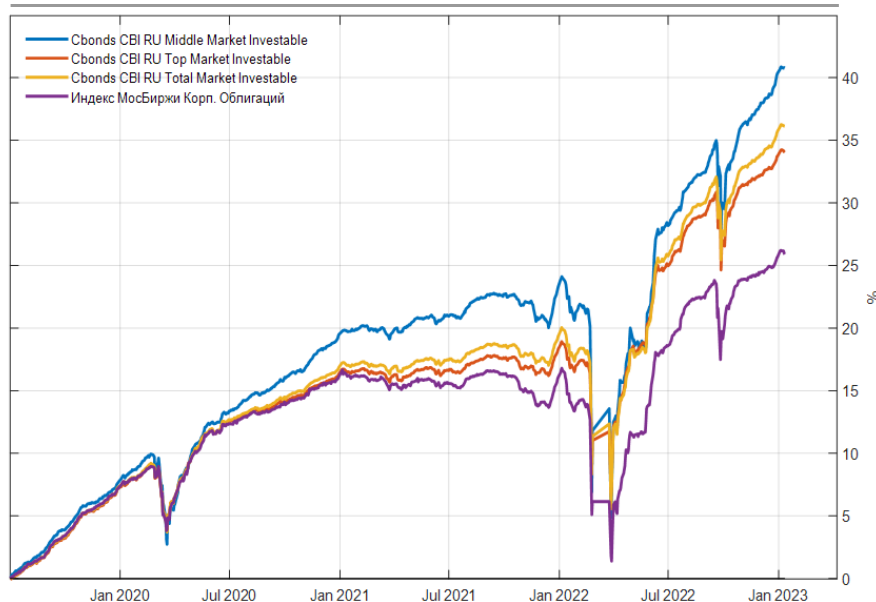


ДОХОДНОСТЬ ПО ГОДАМ (%)

| | 2023 янв | 2022 | 2021 | 2020 | 6 мес. 2019 |
|---------------------------------|----------|-------|-------|------|-------------|
| BOND ETF (СЧА) | 0.36 | - | - | - | - |
| Бенчмарк | 0.3 | 13.84 | 3.18 | 10.9 | 7.75 |
| Индекс МосБиржи Корп. Облигаций | 0.18 | 8.27 | -0.05 | 8.25 | 7.28 |

Не рассчитывается для инструментов, тогующихся менее одного года

ИСТОРИЯ НАКОПЛЕННОЙ ДОХОДНОСТИ БЕНЧМАРКА (%)



ДОПОЛНИТЕЛЬНЫЕ ДАННЫЕ

ПОЛНЫЙ СОСТАВ ФОНДА

| Название | Вес, % | Название | Вес, % | Название | Вес, % |
|-------------------|--------|---------------------------|--------|---------------------------|--------|
| КИВИФ 1P01 | 4.24 | Белуга Групп-БО-П05 | 2.63 | МВ Финанс-001P-03 | 1.55 |
| ЦППК 1P-03 | 4.13 | МТС-Банк-001P-02 | 2.60 | Брусника 002P-01 | 1.53 |
| Новотр 1P1 | 4.12 | ЛСР БО 1P4 | 2.58 | Сегежа Групп-002P-05R | 1.50 |
| О'КЕЙ Б1P3 | 4.06 | Дебиторская задолженность | 2.37 | ФПК Гарант-Инвест-001P-05 | 1.45 |
| Камаз-БО-П10 | 4.01 | ЯТЭК 1P-2 | 2.26 | ПИК К 1P2 | 1.30 |
| Аэрофл БО1 | 3.99 | МаксимаТелеком-БО-П01 | 2.12 | Сегежа ГК 002P-04R | 1.29 |
| Экспобанк-001P-01 | 3.98 | АБЗ-1-001P-01-6об | 2.07 | Пионер ГК-001P-04-6об | 1.11 |
| УрКаПБО6P | 3.97 | ПИК К 1P4 | 1.93 | СамолетP11 | 1.06 |
| ХКФБанк-4-6об | 3.88 | ЯТЭК 001P-01 | 1.89 | СамолетP12 | 0.82 |
| Боржоми1P1 | 3.82 | Брусника 001P-02 | 1.75 | СамолетP10 | 0.78 |
| ВУШ 1P1 | 3.75 | Сегежа ГК 002P-01R | 1.73 | Самолет1P9 | 0.54 |
| СЛТ001P-04 | 3.18 | Белуга Групп-БО-П04 | 1.72 | ГУП ЖКХ РС(Я)-БО-01 | 0.53 |
| Инарктика-001P-01 | 3.06 | Джи-гр 2P1 | 1.70 | ЧеркизБ1P2 | 0.06 |
| iСелктлP1R | 3.04 | МаксимаТелеком-БО-П02 | 1.69 | Денежные средства | 0.00 |
| МВ ФИНАНС 001P-02 | 2.63 | ГК Пионер БО 001P-05 | 1.57 | | |

Эксперты в инвестициях

- Мы управляем активами клиентов более 19 лет
- Более 40 млрд. руб. в управлении
- В текущем управлении 6 биржевых, 7 открытых, 19 закрытых паевых фондов, эндаумент-фонды и компенсационные фонды СРО
- Лицензии Банка России, членство НАУФОР

ООО «УК «ДОХОДЪ». 199178, Санкт-Петербург, проспект Малый В.О., д. 43, корпус 2

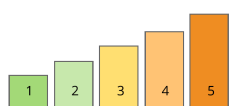
Лицензия на осуществление деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами, негосударственными пенсионными фондами № 21-000-1-00612 от 20.12.2008 г.

Лицензия на осуществление деятельности по управлению ценными бумагами № 040-09678-001000 от 14 ноября 2006 г. Без ограничения срока действия.

Компания является членом саморегулируемой организации НАУФОР.

МЕТОДИКА РАСЧЕТА УРОВНЯ РИСКА

Уровень риска рассчитывается исходя из стандартного отклонения изменений недельных доходностей фонда за пять лет. Если фонд существует менее пяти лет, то исходя из изменений доходности фонда за время его существования и изменений доходностей ближайшего бенчмарка фонда за оставшееся время до периода в пять лет. Полученное недельное стандартное отклонение переводится в годовое значение путем умножения на 52 в степени 0.5. Уровень риска в баллах от 1 до 5 определяется путем определения соответствия полученного годового стандартного отклонения со значениями, приведенными в списке ниже. Меньший уровень риска означает меньший риск и меньшую ожидаемую доходность. Большой уровень риска означает больший риск и более высокую ожидаемую доходность.



- Уровень 1: менее 2%
- Уровень 2: от 2 до 6%
- Уровень 3: от 6 до 12%
- Уровень 4: от 12 до 17%
- Уровень 5: 17% и выше

ОБЯЗАТЕЛЬНАЯ ИНФОРМАЦИЯ

Ознакомиться с условиями управления активами, получить подробную информацию о паевых инвестиционных фондах, ознакомиться с правилами доверительного управления и иными документами, подлежащими раскрытию и предоставлению в соответствии с действующим законодательством, до заключения договора можно в ООО «УК «ДОХОДЪ» по адресу: 199178, Санкт-Петербург, Малый пр. В.О., д. 43, корп. 2, литера В, 3 этаж, помещ. 62, на сайте dohod.ru по телефону (812) 635-68-63. Правила доверительного управления БПИФ РФИ "ДОХОДЪ Сбондс Корпоративные облигации РФ" зарегистрированы Банком России 31 марта 2022 г. за № 4920.

Внимание! Взимание надбавок (скидок) уменьшает доходность инвестиций в инвестиционные паи паевых инвестиционных фондов. Прежде чем приобрести инвестиционный пай, следует внимательно ознакомиться с правилами доверительного управления паевым инвестиционным фондом. Стоимость инвестиционных паев может увеличиваться и уменьшаться, результаты инвестирования в прошлом не определяют доходы в будущем, государство не гарантирует доходность инвестиций в инвестиционные фонды.

Информация, представленная в данном документе (далее также - Информация) подготовлена специалистами компании ООО "УК "ДОХОДЪ" (далее также - Компания), является интеллектуальной собственностью Компании и предназначена для использования на территории России в соответствии с российским законодательством. При подготовке этой Информации были использованы материалы из источников, которые, по мнению специалистов Компании, заслуживают доверия. При этом такая Информация предназначена исключительно для информационных целей, не содержит рекомендаций и, там, где это применимо, является выражением частного мнения специалистов Компании. Невзирая на осмотрительность, с которой специалисты Компании отнеслись к сбору и составлению Информации, Компания не дает никаких гарантий в отношении ее достоверности и полноты.

Компания не обещает и не гарантирует доходность. Стоимость инвестиций может увеличиваться и уменьшаться, результаты инвестирования в прошлом не определяют доходы в будущем. Финансовые результаты, полученные в результате инвестиций, не застрахованы и не гарантированы государством, в том числе, Агентством по страхованию вкладов или Банком России.

Информация, представленная здесь, не является индивидуальной инвестиционной рекомендацией, а упоминаемые финансовые инструменты могут не подходить вам по инвестиционным целям, допустимому риску, инвестиционному горизонту и прочим параметрам индивидуального инвестиционного профиля.

Информация действительна на момент ее публикации. При этом Компания вправе в любой момент внести в нее любые изменения. Распространение, копирование, изменение, а также иное использование Информации или какой-либо ее части без письменного согласия Компаний не допускается. Компания, ее агенты, сотрудники и аффилированные лица могут в некоторых случаях участвовать в операциях с ценными бумагами, упомянутыми в Информации, или вступать в отношения с эмитентами этих ценных бумаг. Компания предупреждает, что операции с ценными бумагами связаны с различными рисками и требуют соответствующих знаний и опыта.