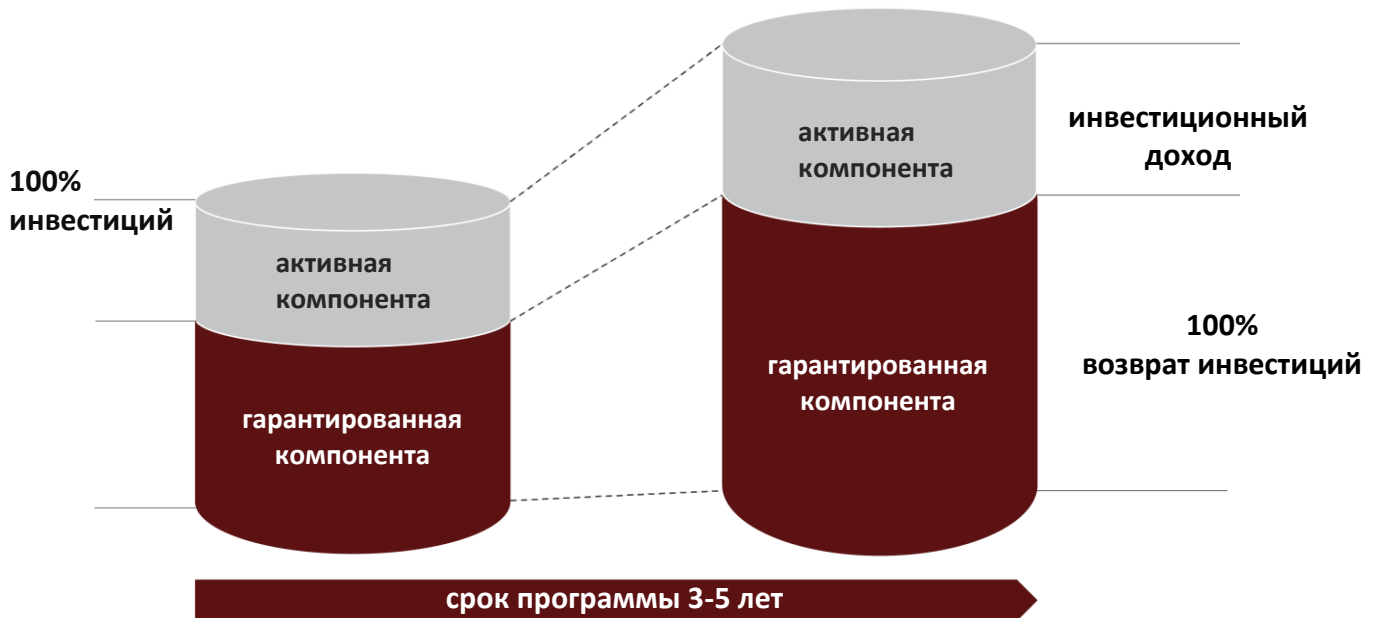


Инвестиционный продукт с гарантией капитала Augmentum + Investment Grade Bonds



Инвестиционная идея: распределение портфеля Инвестора по двум компонентам:

Гарантированная компонента - облигации инвестиционного рейтинга с доходностью 3-5%, с реинвестированием купона.

Активная компонента – высокодоходная стратегия Augmentum на рынке американских казначейских облигаций со среднегодовой доходностью 25%.

Способ приобретения продукта: Managed account, либо покупка по ISIN на брокерский или банковский счет.

Параметры

Тип продукта	Индивидуальный продукт
Валюта	USD
Рекомендуемый объем инвестиций:	100 000 USD - 1 000 000 USD
Срок инвестирования	5 лет
Готовность к рискам	Низкая
Вознаграждение управляющего	2% в год, 20% за успех

Структура активов в продукте:

19,7% - Стратегия Augmentum (доходность 25%)

80,3% - Облигации инвестиционного рейтинга (доходность 4,5%)

через 5 лет

Гарантированная компонента = 100%

Активная компонента = 60,1%

Среднегодовая доходность = 12%

Формируется оптимальный портфель облигаций, динамично ребалансируемый в соответствии с текущей рыночной ситуацией. Алгоритм анализирует надежность составленного портфеля облигаций и высчитывает их оптимальное соотношение, учитывая корреляцию между ними.

Примеры облигаций инвестиционного рейтинга:

Issuer (ISIN)	Maturity date	Years till maturity	Credit rating	Price	Coupon	Modified duration**	Yield	Currency	Issuer location
UBS AG (US870836AC77)	15.07.2025	6.5	BBB+ (S&P)	113.87	7,5%	5,2228	4,95%	USD	Switzerland
Goldman Sachs Group Inc. (US38141GRD87)	22.01.2023	4	BBB+ (S&P)	98.92	3,625%	3,8050	3,9%	USD	U.S.
Anheuser-Busch InBev (US035242AP13)	01.02.2026	7	A- (S&P)	94.58	3,65%	6,2641	4,57%	USD	Multi national /E.U.
Deutsche Telekom (USN27915AS11)	18.01.2027	8	BBB+ (S&P)	91.97	3,60%	6,8537	4,80%	USD	Germany
Royal Bank of Scotland (US780097AZ42)	19.12.2023	5	BBB- (S&P)	103.03	6,00%	4,2608	5,37%	USD	U.K.

*Возможно увеличение доходности портфеля и сокращение срока инвестирования за счет использования плеча. Приобретение гарантированной компоненты на 100% капитала позволяет использовать дополнительные 20% в качестве заемных средств для работы с высокодоходной компонентой. Стоимость заемного капитала составит при этом 2,5%.

Контакты

Terreus Capital
123317, Москва,
Москва - Сити, Пресненская наб., 6 стр. 2,
Деловой комплекс «Империя», офис 4403
Тел.: +7 (495) 727-6360
E-mail: Info@terreuscapital.ru

Contact Details

Terreus Capital AG
Hottingerstrasse 21
8032 Zurich Switzerland
T +4143 588 06 72
info@terreuscapital.ru
www.terreuscapital.ru