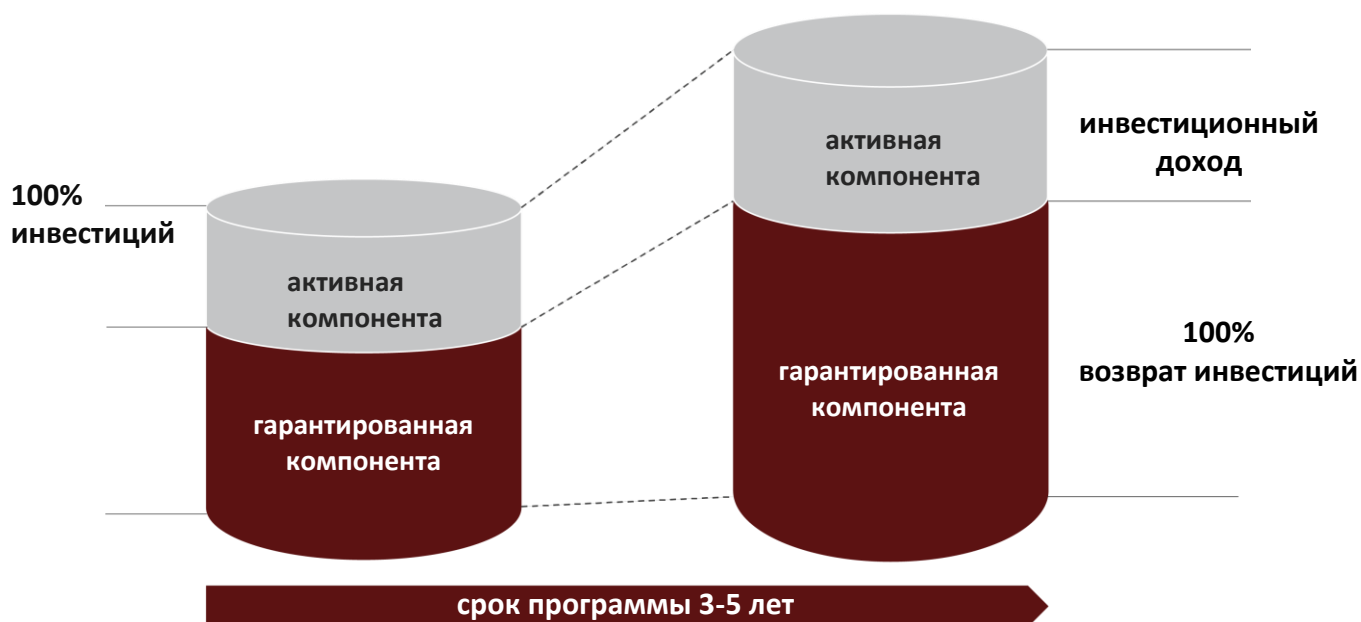


Инвестиционный продукт с гарантией капитала Short S&P500 + Investment Grade Bonds



Инвестиционная идея: распределение портфеля Инвестора по двум компонентам:

Гарантированная компонента - облигации инвестиционного рейтинга с доходностью 4-5%, с реинвестированием купона.

Активная компонента – стратегия Short S&P500, приносящая прибыль при падении американского рынка акций.

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

Комментарий инвестиционного аналитика

В настоящее время рынок американских акций сильно перегрет. Эксперты ожидают существенного падения в ближайшие годы, и мы не можем не предложить нашим инвесторам воспользоваться этим с помощью стратегии Short S&P500, рассчитанной на падение фондового рынка и приносящей прибыль, соизмеримую с масштабом падения рынка американских акций. В зависимости от сценария падения, ожидаемая среднегодовая доходность составит 90%-130%.

Ожидаемая доходность продукта в целом при разных сценариях:

1. Падение индекса S&P на 50% через 5 лет

Гарантированная компонента = 100%
Активная компонента = 665%
Среднегодовая доходность = 133%

2. Падение индекса S&P на 30% через 5 лет

Гарантированная компонента = 100%
Активная компонента = 453%
Среднегодовая доходность = 90%

**3. Индекс S&P не упадет,
а наоборот вырастет** через 5 лет

Гарантированная компонента = 100%
Активная компонента = 0%
Среднегодовая доходность = 0%

Таким образом, даже в случае развития событий в направлении, противоположном прогнозируемому, инвестор не потеряет свой капитал.

Примеры облигаций инвестиционного рейтинга:

Issuer (ISIN)	Maturity date	Years till maturity	Credit rating	Price	Coupon	Modified duration**	Yield (investment type)	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.

Контакты

Terreus Capital
 123317, Москва,
 Москва - Сити, Пресненская наб., 6 стр. 2,
 Деловой комплекс «Империya», 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