



# PROTEA FUND - GAMA GLOBAL SHORT-DATED OPPORTUNITIES

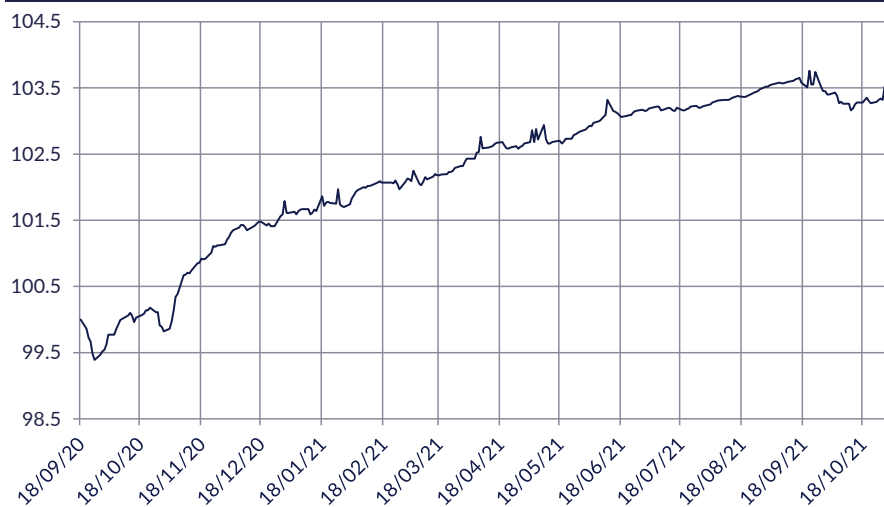
## ЕЖЕМЕСЯЧНЫЙ ОТЧЁТ (USD F ACC) - 29 ОКТЯБРЬ 2021 Г.

### ОБЗОР ФОНДА

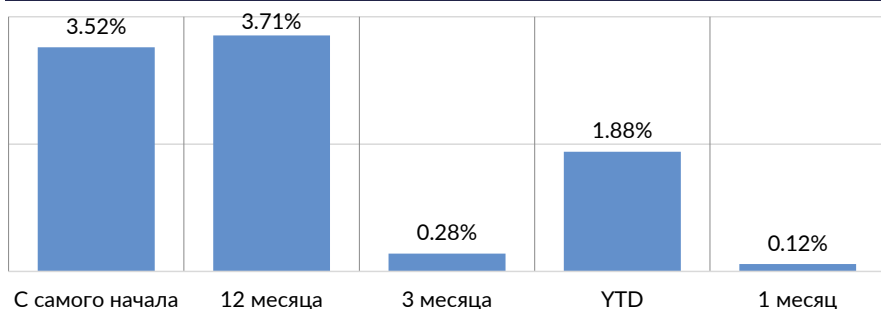
GAMA Global Short-Dated Opportunities фонд краткосрочных облигаций для инвесторов, стремящихся к более высокой доходности, чем фонды денежного рынка. Инвестиционная цель фонда - генерировать доходность в размере 2% годовых сверх наличных средств с волатильностью в диапазоне 2% -3%. Фонд подходит инвесторам с инвестиционным горизонтом от одного года.

Ожидается, что основным источником дохода фонда будет кредитная задолженность. Риски по процентным ставкам остаются на низком уровне, а валютные риски полностью хеджируются. Управляющие фондами следуют строгому инвестиционному процессу, который сочетает в себе глубокий фундаментальный анализ и надежные количественные модели с целью использования возможностей, которые существуют на коротком конце глобального корпоративного рынка облигаций.

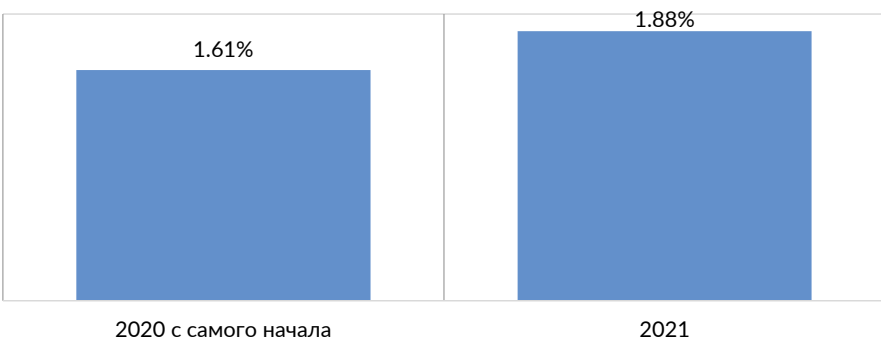
### ДОХОДНОСТЬ С САМОГО НАЧАЛА (В USD, ЗА ВЫЧЕТОМ СБОРОВ)



### СОВОКУПНАЯ ДОХОДНОСТЬ (В USD, ЗА ВЫЧЕТОМ СБОРОВ)



### ЕЖЕГОДНАЯ ДОХОДНОСТЬ (В USD, ЗА ВЫЧЕТОМ СБОРОВ)



Прошлые показатели не гарантируют будущих результатов. Представление данных о результатах не включает комиссии и иных издержек возникших вследствие выпуска и выкупа паев. Доходность представлена за вычетом сборов.

### РИСК / ДОХОДНОСТЬ



### ОСНОВНЫЕ СВЕДЕНИЯ

Правовая структура	UCITS SICAV
Место регистрации	Люксембург
Дата формирования	18 Сентябрь 2020 г.
Управляющий	GAMA Asset Management SA
Управляющие фонда	Christophe Pella, CFA Jérôme Strecker, CFA, FRM Manuel Streiff, CFA, FRM
Размер фонда	USD 140 млн
Ликвидность (подп./погаш.)	Ежедневно
Срок	16 ч. на следующий рабочий день
Заем ценных бумаг	нет
Администратор	FundPartner Solutions SA
Представитель в Швейцарии	FundPartner Solutions (Suisse) SA
Депозитарный банк	Pictet & Cie (Europe) SA
Платёжный агент в Швейцарии	Banque Pictet & Cie SA
Аудитор	Deloitte Audit Sàrl

### Характеристики портфеля

Доходность с валютным хедж	2.24%
Средняя Доходность Выше Денежной	2.19%
Срок обращения (годы)	1.75
Дюрация процентных ставок	1.64
Спред доходности	2.24
средний кредитный рейтинг	BBB
Средний спред (базисный пункт)	206
Количество эмитентов	160
Позиции в составе фонда	176
Максимальный дродаун (С 2015)	-0.61%

### КЛАСС АКТИВОВ USD F ACC

СЧА	USD 103.52
ISIN	LU2092462014
Valor	51423685
Bloomberg	PGGSOFU LX
Мин. сумма	USD 20 млн
полученный доход	Реинвестированный
Комиссия за управление (в год)	0.20%
операционные сборы	0.15%
поощрительная премия	Никакая

Пожалуйста, обратитесь к отчету о других доступных классах.

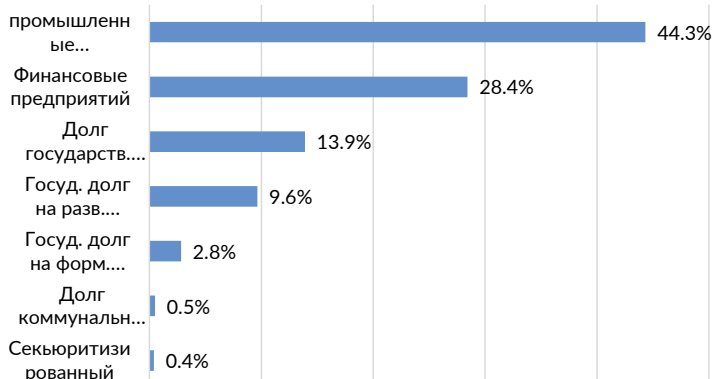
### КОНТАКТНАЯ ИНФОРМАЦИЯ

Адрес	GAMA Asset Management SA Rue de la Pépisserie 16 CH-1204 Genève, Suisse
Телефон	+41 22 318 00 33
Эл. Адрес	info@gama-am.ch

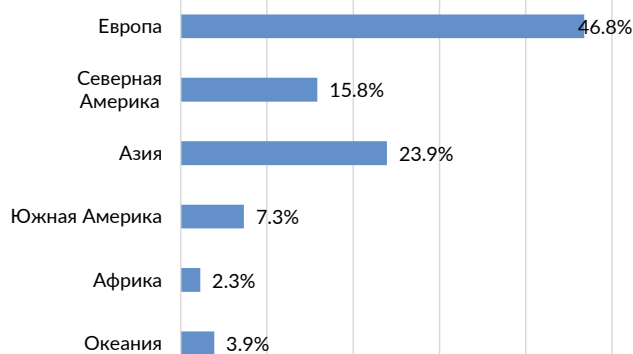
# PROTEA FUND - GAMA GLOBAL SHORT-DATED OPPORTUNITIES

ЕЖЕМЕСЯЧНЫЙ ОТЧЁТ (USD F ACC) - 29 ОКТЯБРЬ 2021 Г.

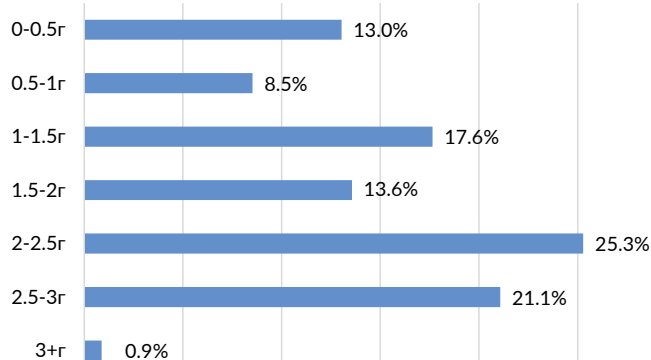
## РАСПРЕДЕЛЕНИЕ ПО ОТРАСЛЯМ



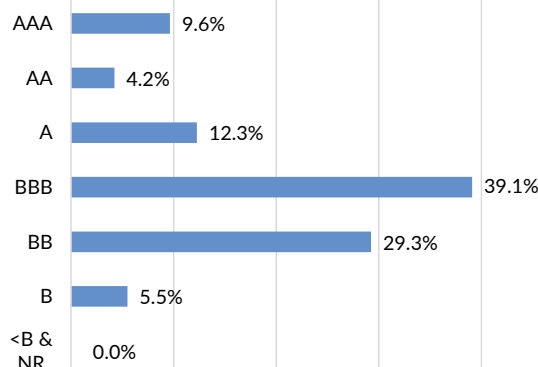
## ГЕОГРАФИЧЕСКОЕ РАСПРЕДЕЛЕНИЕ



## ПО СРОКА ПОГАШЕНИЯ



## РАСПРЕДЕЛЕНИЕ ПО РЕЙТИНГУ



## ТОП-10 ЭМИТЕНТОВ

Название	Отрасль	Страна	%
Federal Republic of Germany	Госуд. долг на разв. рын	DE	7.5%
United States of America	Госуд. долг на разв. рын	US	2.1%
1Malaysia Development Bhd	Долг государств. органи	MY	1.5%
Cnac Hk Finbridge Co Ltd	Долг государств. органи	CN	1.3%
Gcc Sab De Cv	промышленные предпр	MX	1.1%
Multibank Inc.	Финансовые предприятия	PA	1.1%
Gazprom PJSC	Долг государств. органи	RU	1.0%
Hoist Finance AB	Финансовые предприятия	SE	1.0%
Lagardere SA	промышленные предпр	FR	1.0%
Ford Motor Co	промышленные предпр	GB	1.0%
<b>Всего</b>			<b>18.7%</b>

## РАСПРЕДЕЛЕНИЕ ПО СТРАНАМ



## ЕЖЕМЕСЯЧНАЯ ПРИБЫЛЬ (В USD, ЗА ВЫЧЕТОМ СБОРОВ)

	2020	2021
Январь		0.09%
Февраль		0.27%
Март		0.40%
Апрель		0.27%
Май		0.20%
Июнь		0.27%
Июль		0.08%
Август		0.28%
Сентябрь	-0.46%	-0.12%
Октябрь	0.28%	0.12%
Ноябрь	1.32%	-
Декабрь	0.46%	-
<b>Год</b>	<b>1.61%</b>	<b>1.88%</b>

Настоящая публикация предназначена для ограниченного распространения и носит исключительно информационный характер. Она не содержит индивидуальных инвестиционных рекомендаций и не является предложением о покупке или продаже, а также приглашением совершить покупку (продажу) каких-либо ценных бумаг упоминаемых фондов. Мы не несем ответственности за какие-либо убытки, возникшие в результате использования данной информации. Ответственность за соблюдение соответствующих ограничений возлагается на получателя. GAMA не несет ответственности за нарушение предусмотренных законодательством ограничений. В любых обстоятельствах следует руководствоваться проспектом фонда. Проспект, ключевой информационный инвестиционный документ и самые последние годовые и полугодовые отчеты предоставляются бесплатно у Представителя Швейцарии по адресу Route des Acacias 60, CH-1211 Geneva. Деятельность GAMA Asset Management SA регулируется Управлением надзора за операциями финансового рынка Швейцарии (FINMA).