

Рарех фонд Облигаций Восточной Европы

Отчет фонда на 30/06/2010

пл. Републикас, 2а
Рига LV-1010, Латвия
Тел. (371) 67010810
Факс (371) 67778622
PAM@parex.lv
www.pam.lv

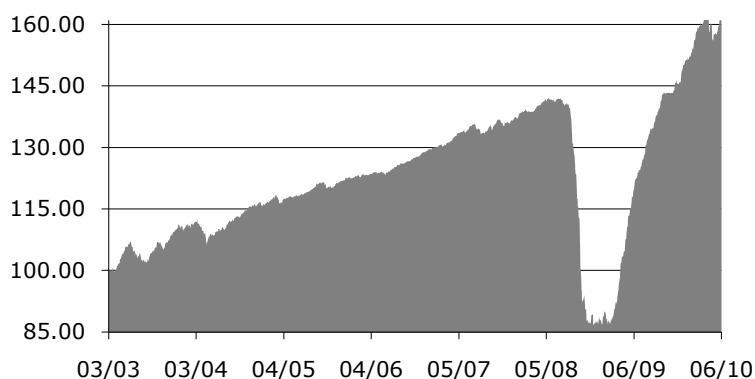
PAREX
ASSET
MANAGEMENT

Инвестиционная политика

Основная задача данного фонда - увеличение стоимости капитала путем инвестирования основной части средств в диверсифицированный портфель ценных бумаг с фиксированным доходом стран Балтии и Восточной Европы, имеющих сравнительно высокие инвестиционные рейтинги, которые могут быть эмитированы в различных валютах.

Дата создания	12/03/2003
Базовая валюта	USD
Объем активов	USD 17.8 mln
Минимальный объем инвестиций	1 удостоверение вложения
Стоимость доли	16.16
Комиссия за покупку	1.00%
Комиссия за управление	1.50% в год
Код на РФБ, Bloomberg	PXSPAOFR, PAREEUB LR\$
ISIN код	LV0000400125
Покупка, продажа долей	Ежедневно
Управляющие	Э. Макаров, А. Котанс

Изменение индекса с начала деятельности



Крупнейшие вложения

GAZPROM INTL SA (GAZPROM)	4.58%
CenterCredit International BV	4.35%
ALLIANCE OIL CO LTD	4.29%
Bank of Georgia JSC	4.29%
Azovstal Iron & Steel Works PJSC	3.72%
KAZMUNAIGAZ FINANCE SUB	3.60%
HALYK SAVING BANK-KAZAK	3.46%
MOL HUNGARIAN IOL AND GAS	3.17%
Parex Bank	3.08%
NAFTOGAZ UKRAINY	2.99%
ВСЕГО:	37.51%

Доходность

на 30/06/2010

С начала года*	1 месяц *	3 месяца *	6 месяцев *	1 год *	2 года ср.годовая**	3 года ср.годовая**	С момента создания*	Среднегодовая с момента создания**
10.38%	2.15%	0.87%	10.38%	30.64%	6.75%	6.17%	61.60%	6.79%

по годам*

2003***	2004	2005	2006	2007	2008	2009
9.90%	5.99%	4.81%	5.98%	5.64%	-36.21%	67.89%

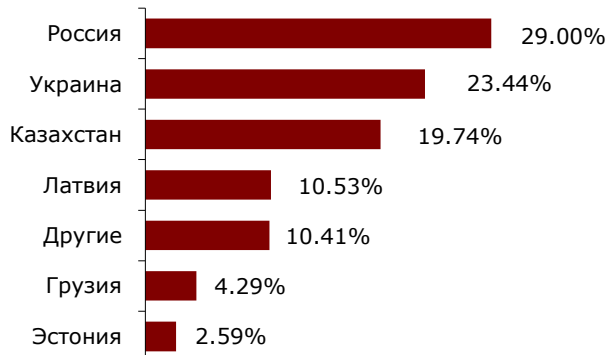
* - Доходность рассчитана, как отношение изменения цены доли за отчетный период к цене доли в начале периода.

** - Данные рассчитаны в процентах годовых по методике АСТ/365

*** - С 12/03/03

Структура портфеля

по странам



по секторам



по валютам

USD	91.51%
RUR	6.78%
UAH	1.70%

Статистика

Количество ценных бумаг в фонде	39
Средний срок погашения облигаций	2.60
Доходность к погашению облигаций	8.70%

по инструментам

Корп. облигации	91.31%
Денежные средства	6.99%
Гос. облигации	1.43%
Другие	0.27%

Настоящий материал имеет исключительно информационный характер и не является предложением или рекомендацией купить или продать упомянутые в нем ценные бумаги. Историческая доходность не является гарантией будущей доходности, стоимость вложений может как увеличиваться, так и снижаться, и нет никакой гарантии, что инвесторы получат назад первоначально вложенный объем средств. Управление фондом осуществляется в соответствии с указанной инвестиционной политикой, без дополнительного согласования.