

31.12.2011. faktu ziņojums

SEB Aktīvu atlasē fonds

SEB Asset Selection Fund



Fonda pārvaldnieks: Hans-Olov Bornemann

Nodarbināts nozarē: 21 gadi

Fonda mērķis ir sniegt absolūto atdevi un ieguldīt visās galvenajās aktīvu klasēs.

Ieguldījumu filozofija

Komanda uzskata, ka var gūt lielāko atdevi, pieņemot lēmumus par aktīvu izvietojumu starp galvenajām aktīvu klasēm – akcijām, fiksētā ienākuma vērtspapīriem, valūtām un dabas resursiem un izejvielām. Fonda mērķis ir gūt absolūto atdevi, kas ir 5% virs naudas tirgus likmēm pēc komisijām pie 10% standartnovirzes līmeņa.

Ieguldījumu process

Ieguldījumu fokuss

Lai maksimizētu atdevi un nodrošinātu labu diversifikāciju, komanda var veikt ieguldījumus visā pasaulē četrās aktīvu klasēs: akcijās, fiksētā ienākuma vērtspapīros, valūtās un dabas resursos un izejvielās. Tā kā SEB Asset Selection ir UCITS III fonds, tas nedrīkst veikt tiešus ieguldījumus dabas resursos un izejvielās, (piemēram, varā vai kviešos), bet tikai dabas resursu un izejvielu indeksā un apakšindeksu nākotnes līgumos. Fonds nedrīkst ieguldīt citos fondos vairāk nekā 10% no tīrās aktīvu vērtības.

Ieguldījumu komanda

Komandā, kuru vada Hans-Olov Bornemann, bijušais Deutsche Bank izpilddirektors, ir pieci uzcītīgi dalībnieki, kuriem ir aizrautīga attieksme pret ieguldījumiem, liela vēlme mācīties un ir lieliskas problēmu risināšanas prasmes. Komandas dalībniekiem patīk sacensties, un viņu mērķis ir būt par labākajiem viņu globālajā segmentā. Komandas kultūru raksturo vēlme pastāvīgi mācīties, koncentrēšanās uz pētījumu un risku vadību, kā arī klientam draudzīgi produkti. Komandai kopumā ir aptuveni 60 gadu darba pieredze finanšu tirgos. Komanda ir dibināta 2003. gada oktobrī, un tā atrodas Stokholmā. Nevieni no dalībniekiem nav pametis komandu no 2003. gada oktobra.

Izpēte

Ieguldījumu procesā komanda izmanto kvantitatīvu metodi. Tirgus neefektivitātes tiek atklātas ar rūpīgu pētījumu un pagātnes datu

pārbaudes palīdzību. Komanda pati izveidoja kvantitatīvu modeli, kas veic pamatdarbības rādītāju, tehnisko un uzvedības faktoru analīzi.

Portfeļa izveide

Portfeļa izveides procesa mērķis ir maksimizēt ar risku koriģētu absolūto atdevi, vienlaikus saglabājot ilgtermiņa korelāciju ar akciju un obligāciju tirgiem pēc iespējas zemākajā līmenī (mērķa ilgtermiņa korelācijas līmenis ir +/- 0,20).

Vēsturiskie rezultāti (EUR)

Kopējā fonda aktīvi (milj. EUR): 1495.59 (30 Nov 2011) Fonda daļas vērtība EUR: 14.3684



— SEB Aktīvu atlasē fonds

Avots: SEB Asset Management S.A.

Ienesīgums % EUR

Absolūtais pieaugums %

Pēdējos 3 mēnešos	-1.94
Pēdējos 6 mēnešos	4.54
Pēdējā gadā	1.59
Kopš gada sākuma	1.59

Avots: www.seb.lv

Vidējais gada ienesīgums %

Pēdējos 2 gadus	1.79
Pēdējos 3 gadus	0.56
Pēdējos 4 gadus	6.06
Pēdējos 5 gadus	6.65

Pamatinformācija

Fonda tips	alternatīvais
Reģistrācijas gads	2006
ISIN kods	LU0256624742
Daļas vērtība sākumā	10.00 EUR
Salīdzinošais indekss	Nav
Fonda pārvaldošā sabiedrība	SEB Asset Management S.A.
Morningstar reitings (3 gadu)	-
Bāzes valūta	EUR
Daļu tips	C* (EUR)
Bloomberg kods (ticker)	SEBASEC LX

Dividendes

*Fonds neizmaksā dividendes, bet tās tiek reinvestētas

Izmaksas

Pārvaldīšanas komisija*	1.10%
Cenu grupa 3	
Pirkšanas komisija filiālē vai Ibankā**:	0.75%
Pārdošanas komisija:	0%
Maiņas komisija:	0%

* iekļauts daļas vērtībā

** komisija netiek piemērota dzīvības apdrošināšanai ar līdzekļu uzkrāšanu

Riska novērtējums (EUR)*

Standarta novirze	7.70%
-------------------	-------

Novirze no indeksa (tracking error)

Standarta novirze raksturo fonda vērtības vēsturiskās svārstības.

Novirze no indeksa parāda fonda vērtības svārstības attiecībā pret salīdzināmo indeksu.

* 3 gadu rādītāji

Lielākie ieguldījumi*

(30 Sep 2011)	
Euribor Short Future LIFFE 3M	54.4%
US Long Bond CBT 2 Year	51.0%
Japan Bond 10 Year	38.9%
Euro Schatz Eurex 2 Year	36.5%
UK Short Future LIFFE 3M	29.5%
US Short Future CME 3M	-24.5%
Svenska Staten 1054	22.4%
US Long Bond CBT 5 Year	17.5%
Euro Bobl Eurex 5 Year	14.4%
Svenska Staten 1050	13.1%

Avots: SEB Asset Management S.A.

*Fondā ekspozīcija var būt lielāka nekā kopējā fonda aktīvi

Valūtas ekspozīcija %

EUR	100
-----	-----

Avots: SEB Asset Management S.A.

Papildu informāciju varat iegūt www.seb.lv, pa tālruni 8777 vai apmeklējot jebkuru SEB bankas filiāli.

Šo mārketinga paziņojumu ir sagatavojusi AS "SEB banka". Tas satur vispārīgu mārketinga informāciju par AS "SEB banka" pieejamiem finanšu instrumentiem, ieguldījumu pakalpojumiem vai blakuspakalpojumiem. Lai gan informācija ir balstīta uz avotiem, kuri tiek uzskatīti par ticamiem, AS "SEB banka" neuzņemas atbildību par neprecizitātēm vai kļūdām, vai jebkādiem zaudējumiem, kas radušies no paļaušanās uz šo informāciju. Ja materiāla ir atsauce uz kādu ieguldījumu pētījumu, iesakām izlasīt pilnu pētījumu un tajā norādītās saistību atzinas. Lūdzam, ievērojiet, ka materiālā sniegtā informācija par nodokļiem ir balstīta uz šobrīd piemērojamiem likumiem, taču nodokļu likumi laika gaitā var mainīties. Nodokļu likumu izmaiņu rezultātā būs atšķirīgs katrā individuālā gadījumā. Ieguldījumi ir pakļauti riskiem. Ieguldījumu vērtība var palielināties vai samazināties un vēsturiskie rezultāti un/vai ienesīgums nav drošs rādītājs nākotnes rezultātu un/vai ienesīguma prognozēšanai un nēgarantē līdzvērtīgu rezultātu un/vai ienesīgumu nākotnē.

Jūsu ieguldītājs kapitāls nav garantēts un dažos gadījumos zaudējumi var pārsniegt sākotnējo ieguldījumu. Ja ieguldījumu fondi vai Jūs personīgi veicat ieguldījumu ārvalstu valūtās izteiktos finanšu instrumentos, ievērojiet, ka valūtas maiņas kursu izmaiņas var ietekmēt rezultātu un/vai ienesīgumu. Jūs pats uzņemat atbildību par lēmumu veikt ieguldījumu un Jums vienmēr pirms tā veikšanas vajadzētu iegūt papildus informāciju. Papildinformācijai lūdzam skatīt arī saistošo prospektu un informatīvo brošūru par SEB fondiem un citiem finanšu instrumentiem, ieguldījumu pakalpojumiem vai blakuspakalpojumiem, kas pieejama AS "SEB banka" mājaslapā: www.seb.lv. Nepieciešamības gadījumā sazinieties ar savu AS "SEB banka" klientu apkalpošanas speciālistu.

