

# Данные на 31.12.2011. SEB Asset Selection Fund



Управляющий фондом: Hans-Olov Bornemann

Опыт в данной отрасли 21 лет

Этот фонд нацелен на достижение абсолютной доходности путем вложения средств во все основные классы активов.

## Философия инвестиций

Команда считает, что можно извлечь дополнительную прибыль путем размещения активов во все основные классы, такие как акции облигации, валюта и сырье. Целью фонда является абсолютная доходность размером в 5 % по сравнению с безрисковой ставкой после издержек с целевым колебанием в 10 %.

## Инвестиционный процесс

### Инвестиционные объекты

Чтобы максимизировать доходность и обеспечить хорошую диверсификацию, команда может инвестировать в четыре класса активов во всем мире: акции, облигации, валюту и сырье. SEB Asset Selection является фондом UCITS III. Фонд не может инвестировать в один конкретный вид сырья, например медь или пшеницу, а только в сырьевой индекс и субиндексные фьючерсы. Фонд не может инвестировать более 10 % от стоимости чистых активов фонда в другие фонды.

### Инвестиционная команда

Команда во главе с Хансом-Оловом Борнеманном, бывшим директором-распорядителем Deutsche Bank, состоит из пяти трудолюбивых сотрудников, с увлечением относящихся к процессу инвестирования, они обладают большим желанием учиться и отлично умеют решать проблемы. Члены команды работают в условиях здоровой конкуренции и стремятся быть лучшими в своей отрасли. Культура команды характеризуется непрерывным обучением, акцент делается на научных исследованиях и управлении рисками, а также продуктах, дружелюбных для клиентов. В целом команда имеет опыт работы на финансовых рынках, действующих 60 лет. Команда была создана в октябре 2003 года и находится в Стокгольме. За все время существования команды с октября 2003 года ни один из участников не ушел и не был уволен

### Исследование

Команда использует количественный инвестиционный подход. Неэффективности рынка выявляются путем проведения тщательных исследований и проверки исторических данных. Эта группа разработала собственные количественные модели, которые включают в себя анализ фундаментальных и технических показателей, а также поведенческих факторов.

### Создание портфеля

Процесс создания портфеля направлен на максимизацию абсолютной доходности с поправкой на риск, при этом поддерживается

наиболее низкий уровень корреляции акций и облигаций в долгосрочной перспективе (целевая долгосрочная корреляции +/-0,20).

## Исторические результаты (EUR)

Общие активы фонда (млн. EUR): 1495.59 (30 Nov 2011) Цена доли фонда EUR: 14.3684



— SEB Asset Selection Fund

Источник: SEB Asset Management S.A.

## Доходность в % (EUR)

### Абсолютная доходность в %

За последние 3 месяца	-1.94
За последние 6 месяцев	4.54
За последний год	1.59
С начала года	1.59

### Среднегодовая доходность в %

За последние 2 года	1.79
За последние 3 года	0.56
За последние 4 года	6.06
За последние 5 лет	6.65

Источник: www.seb.lv

## Основная информация

Тип фонда	альтернативный
Год регистрации фонда	2006
ISIN код	LU0256624742
Начальная стоимость доли фонда	10.00 EUR
Сравнительный индекс	-
Управляющая фондом компания	SEB Asset Management S.A.
Рейтинг Morningstar (за 3 года)	-
Базовая валюта	EUR

Тип доли фонда	C* (EUR)
Код Bloomberg (ticker)	SEBASEC LX

### Дивиденды

\*Фонд не предусматривает выплату дивидендов, а реинвестирует их

### Комиссии

Комиссия за управление*:	1.10%
Группа 3	
Плата за покупку в филиале и Ibanka**:	0.75%
Комиссия за продажу:	0%
Комиссия за обмен:	0%

\* включено в стоимость доли фонда

\*\* комиссия не распространяется на страхование жизни с накоплением

### Оценка риска (EUR)\*

Стандартное отклонение	7.70%
Отклонение от индекса (tracking error)	-
Стандартное отклонение характеризует исторические колебания цены доли фонда.	
Отклонение от индекса показывает колебания цены фонда по отношению к сравнительному индексу.	

\* показатели за 3 года

## Крупнейшие вложения

(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 Statens 1054	22.4%
US Long Bond CBT 5 Year	17.5%
Euro Bobl Eurex 5 Year	14.4%
Svenska Statens 1050	13.1%

Источник: SEB Asset Management S.A.

Вложения фонда могут привлекать общие активы фонда

## Валюты вложений в %

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

Источник: SEB Asset Management S.A.

Дополнительную информацию можно получить: [www.seb.lv](http://www.seb.lv), по телефону: 8777 или посетив любой филиал SEB banka.

Данное маркетинговое сообщение подготовило AS "SEB banka". Оно содержит общую маркетинговую информацию о доступных в AS "SEB banka" финансовых инструментах, инвестиционных услугах или смежных услугах. Хотя информация основывается на источниках, которые считаются надежными, AS "SEB banka" не несет ответственности за неточности или ошибки, или любые убытки, которые появились из-за доверия к этой информации. Если в материале содержится ссылка на какое-либо исследование о вложениях, рекомендуем прочитать полный текст исследования и представленные в нем правовые оговорки. Пожалуйста, учитывайте, что предоставляемая в материале информация о налогах основывается на применяющихся в данный момент законах, однако налоговое законодательство с течением времени может меняться. Результат изменений налогового законодательства будет различным в каждом конкретном случае. Вложения подвержены риску. Стоимость вложений может увеличиваться и уменьшаться, и исторические результаты и/или доходность не являются надежным показателем для прогнозирования будущих результатов и/или доходности и не гарантируют равноценного результата и/или доходности в будущем.

Ваш вложенный капитал не гарантирован, и в некоторых случаях убытки могут превышать начальное вложение. Если инвестиционные фонды или лично Вы осуществляете вложения в финансовые инструменты, выраженные в иностранных валютах, необходимо учитывать, что колебания обменного курса валют могут влиять на результат и/или доходность. Вы сами берете на себя ответственность за принятие решения осуществлять вложения и всегда перед принятием такого решения Вам следовало бы получить более подробную информацию. Для дополнительной информации просим смотреть также сокращенный проспект или информационную брошюру о фондах SEB и других финансовых инструментах, инвестиционных услугах или смежных услугах, которые доступны на [www.seb.lv](http://www.seb.lv). В случае необходимости свяжитесь со своим консультантом по обслуживанию клиентов AS "SEB banka".

# SEB