

31.12.2011. faktu ziņojums

SEB Globālais fonds

SEB Global Fund

Fonds galvenokārt veic ieguldījumus akcijās un ar akcijām saistītos vērtspapīros dažādās nozarēs un reģionos.

Ieguldījumu filozofija

Lēmumu pieņemšanas pamatā lielākajai daļai investoru ir klasiskā finanšu teorija. Saskaņā ar to tirgus ir pilnībā efektīvs un augstāku ienesīgumu iespējams sasniegt, ieguldot uzņēmumos, kas ir riskantāki nekā tirgus kopumā. Pārvaldnieku komanda uzskata, ka, uzņemoties augstāko risku, portfeļa sagaidāmais ienesīgums nepalielināsies proporcionāli riskam — investori var netikt kompensēti pilnā apmērā par papildu risku, kuru viņi uzņemas. Pārvaldnieku komandas stratēģija ir balstīta uz to, lai fonda ieguldītājiem radītu pievienoto vērtību, izmantojot situācijas, kad tirgus dalībnieki rīkojas neracionāli.

Ieguldījumu process

Ieguldījumu fokuss

Fonds iegulda akciju tirgus instrumentos dažādās nozarēs un reģionos. Globāls ieguldījumu pārvaldes mandāts nozīmē, ka risks tiek diversificēts starp dažādiem tirgiem. Fonds lielāko daļu ieguldījumu veic attīstīto valstu akciju tirgos, taču daļu ieguldījumu var veikt arī jaunattīstības valstu tirgos. Fondam ir salīdzinoši augsts aktīvā riska līmenis (6–10%), un tas nozīmē, ka fonda portfeļa sastāvs var būtiski atšķirties no salīdzinošā indeksa sastāva. Tas nozīmē arī, ka fonda daļas vērtību izmaiņas var būtiski atšķirties no salīdzinošā indeksa vērtības izmaiņām. Tā kā fonds veic ieguldījumus ārpus Zviedrijas, fonda aktīvu vērtību ietekmē arī Zviedrijas kronas svārstības relatīvi pret citām valūtām. Fonda pārvaldīšanas procesā ir iespējams izmantot arī atvasinātos finanšu instrumentus.

Ieguldījumu komanda

Fonda pārvalda QPM (Quantitative Portfolio Management) komanda. Komanda izmanto galvenokārt kvantitatīvo un uz stingriem noteikumiem balstīto pieeju. Fonda pārvaldes komanda ir atbildīga par realizēto fonda stratēģiju un par fonda darbības rezultātiem.

Komanda bāzējas Stokholmā, Zviedrijā.

Izpēte

Komanda izmanto uz kvantitatīvo analīzi balstītu ieguldījumu pieeju. Pārvaldnieku komandas mērķis ir izveidot ieguldījumu portfeli ar ievērojami zemāku risku nekā akciju tirgus indeksam, bet ar līdzvērtīgu ienesīgumu. Rūpīga analīze tiek veikta gan konkrētu uzņēmumu līmenī, gan arī pētot, kā atsevišķu akciju iekļaušana portfelī ietekmēs portfeļa kopējos riska rādītājus. Liels uzsvars tiek likts arī uz tirdzniecības un transakciju komisiju minimizēšanu un efektīvu darījumu izpildi. Pārvaldnieku komandas kvantitatīvās analīzes pieeja dod iespēju potenciālo ieguldījumu analīzes procesā iekļaut lielu skaitu uzņēmumu.

Portfeļa izveide

Fonda portfelis tiek veidots, izmantojot pieeju „no apakšas uz augšu”. Ieguldījumu process dod arī lielāku elastīgumu, lai varētu ātri un strauji mainīt portfeļa izvietojumu, piemēram, sektoru alokāciju; ja kāds sektors uzrāda daudz lielāku volatilitāti (risku), tam būs ievērojami mazāks īpatsvars fonda portfelī. Fonda portfeļa aktīvu izvietojums starp sektoriem brīžiem būtiski var atšķirties no salīdzinošā indeksa.

Komandas mērķis ir sasniegt zemāku absolūto riska līmeni nekā ir salīdzinošajam indeksam.

Vēsturiskie rezultāti

Kopējie fonda aktīvi (milj. EUR): 98.98 Fonda daļas vērtība USD: 2.379



Avots: SEB Asset Management S.A.

Ienesīgums % USD

Absolūtais pieaugums %

Pēdējos 3 mēnešos	5.86
Pēdējos 6 mēnešos	-1.05
Pēdējā gadā	4.80
Kopš gada sākuma	4.80

Avots: www.seb.lv

Lielākie ieguldījumi % no fonda aktīviem

Exxon Mobil	2,1
IBM	1,5
Philip Morris International	1,4
Johnson & Johnson	1,4
Apple Computer	1,2
Google	1,2
McDonalds	1,2
Coloplast	1,1
Constellation Brands	1,1
Abbott Laboratories	1,1

Avots: SEB Asset Management S.A.

Fonda pārvaldnieks: Ulrika Bergman

Nodarbināts nozarē: 12 gadus

Pamatinformācija

Fonda tips	akciju
Reģistrācijas gads	1988
ISIN kods	LU0030158231
Daļas vērtība sākumā	1.00 USD
Salīdzinošais indekss	MSCI World Index
Fonda pārvaldošā sabiedrība	SEB Asset Management S.A.
Morningstar reitings (3 gadu)	★★★★★
Bāzes valūta	USD
Daļu tips	C* (USD)
Bloomberg kods (ticker)	SKAEQGI LX

Dividendes

*Fonds neizmaksā dividendes, bet tās tiek reinvestētas

Izmaksas

Pārvaldīšanas komisija*	1.50%
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*

Standarta novirze	12.90%
Novirze no indeksa (tracking error)	6.5%

Standarta novirze raksturo fonda vērtības vēsturiskās svārstības.

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

* 3 gadu rādītāji

Ģeogrāfiskais sadalījums

Ziemeļamerika	55%
Eiropa	25%
Japāna	10%
Āzija (bez Japānas)	7%
Pārējie aktīvi un saistības	3%

Avots: SEB Asset Management S.A.

Valūtas ekspozīcija %

USD	51	AUD	3
GBP	10	HKD	2
JPY	10	SGD	2
EUR	8	ILS	1
CAD	6	SEK	1
CHF	5	DKK	1

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 atrunas. Lūdzu, ievērojiet, ka materiālā sniegta informācija par nodokļiem ir balstīta uz šobrīd piemerojamiem likumiem, taču nodokļu likumi laika gaitā var mainīties. Nodokļu likumu izmaiņu rezultāts 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 negarantē līdzvērtīgu rezultātu un/vai ienesīgumu nākotnē.

Jūsu ieguldītais 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 uzņematies atbildību par lēmumu veikt ieguldījumu un Jums vienmēr pirms tā veikšanas vajadzētu iegūt papildus informāciju. Papildinformācijai lūdzam skatīt arī saistīto 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.

