

31.12.2011. faktu ziņojums

SEB Japānas fonds

SEB Japan Fund

Fonds veic ieguldījumus dažāda tirgus kapitalizācijas uzņēmumu akcijās Japānas tirgū. Fonds ir pārvaldīts sadarbībā ar ieguldījumu pārvaldes uzņēmumu Goldman Sachs Asset Management.

Ieguldījumu filozofija

Mērķis ir sasniegt rezultātus, kas pastāvīgi pārsniedz salīdzinošā indeksa rādītājus. Komanda apvieno tradicionālo uzņēmumu pamatdarbības rādītāju analīzi ar kvantitatīvo modeļu izmantošanu, lai rūpīgi izveidotu un pārvaldītu fonda riska pozīcijas. Tādējādi fonds nodrošina, ka risks ir sadalīts starp ieguldījumu kritērijiem, un pārvalda riskus, lai izvairītos vai ātri reaģētu uz tirgus mainīgajiem apstākļiem. Process attīstās nepārtraukti, lai spētu sniegt pozitīvus, stabilus un atkārtojamus rezultātus.

Ieguldījumu process

Ieguldījumu fokuss

Komanda veic ieguldījumus dažādu nozaru Japānas akcijās. Japānas tirgum ir raksturīgi lieli starptautiski uzņēmumi finanšu un patēriņa nozarēs. Izmantojot CORE procesu (Computer Optimized Research Enhanced), vairāk nekā 1750 Japānas akciju tiek novērtētas katru dienu. No šīm akcijām tiek atlasītas vispievilcīgākās dažādos sektoros, lai izveidotu stabili fonda portfeli.

Ieguldījumu komanda

Fonu pārvalda GSAM Quantitative Investment Strategies(QIS) komanda, kurā ir vairāk nekā 110 ieguldījumu profesionāļu, kuri ir sadalīti četrās funkcionālās jomās: 1) kvantitatīvie pētījumi, kas veido modeļus un procesus; 2) stratēģijas izpilde; 3) portfeļa izveides īstenošana, kas uzrauga optimizāciju un tirdzniecību, un 4) produkta stratēģija, kas kalpo kā galvenā saikne starp klientiem un produkta grupām. Vairāk kā 30 profesionāļi no informācijas tehnoloģijas nodaļas atbalsta ieguldījumu komandu.

Izpēte

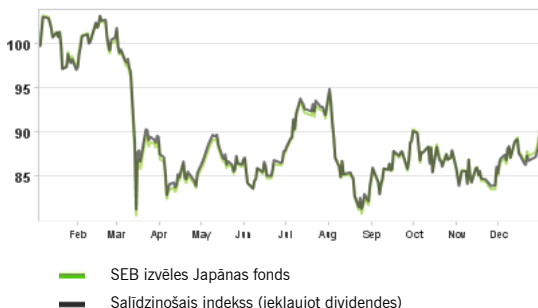
Pašu izveidotie modeļi tika izstrādāti tā, lai aptvertu dažādas tirgus neefektivitātes un lai novērtētu akcijas atbilstoši nozarē līdzīgām akcijām, izmantojot sešus ieguldījumu kritērijus: 1) novērtēšana; 2) ienesīgums; 3) ieņēmumu kvalitāte; 4) pārvaldes ietekme; 5) moments; 6) analītiķu viedoklis. Kritēriji parāda statistiski nozīmīgu iespēju prognozēt vēsturiskus ienesīgumus. Turklāt, tā kā kritēriju korelācija ir zema, katrs kritērijs dod jauno informāciju kopējam akciju pievilcīguma novērtējumam.

Portfeļa izveide

Portfelis tiek veidots, izmantojot optimizācijas procesu, kas maksimizē portfeļa sagaidāmo peļņu, ņemot vērā noteikto riska līmeni. Pašu izveidotie riska modeļi ir izstrādāti, lai identificētu risku, kas ir saistīts ar katru akciju. Mēs necenšamies ieguldīt visu mūsu riska budžetu riskantāku sektoru uzņēmumos, bet gan cenšamies patstāvīgi uzturēt beta riska parametru 1.0 līmenī. Fonda portfeli ir iekļautas dažādu nozaru akcijas, tādējādi samazinās riski, kas ir saistīti ar ieguldījumiem Japānas tirgū.

Vēsturiskie rezultāti

Kopējie fonda aktīvi (milj. EUR): 29.412 Fonda daļas vērtība JPY: 39.8423



Avots: SEB Asset Management S.A.

Lielākie ieguldījumi % no fonda aktīviem

Nissan Motor	3,9
Honda Motor	3,5
Tokio Marine Holdings	2,6
Sumitomo	2,4
Kirin Brewery	2,3
Mitsubishi Tokyo Financial	2,3
Daito Trust Construction	2,2
Takeda Pharmaceutical	2,2
Hitachi	2,1
Kao	1,9

Avots: SEB Asset Management S.A.

Ienesīgums % JPY

Absolūtais pieaugums %

Pēdējos 3 mēnešos	-3.59
Pēdējos 6 mēnešos	-12.22
Pēdējā gadā	-16.23
Kopš gada sākuma	-16.23

Vidējais gada ienesīgums %

Pēdējos 2 gados	-7.80
Pēdējos 3 gados	-3.95
Pēdējos 4 gados	-15.72
Pēdējos 5 gados	-15.59

Avots: www.seb.lv

Pamatinformācija

Fonda tips	akciju
Reģistrācijas gads	1988
ISIN kods	LU0030163587
Daļas vērtība sākumā	100.00 JPY
Salīdzinošais indekss	TOPIX
Fonda pārvaldošā sabiedrība	SEB Asset Management S.A.
Morningstar reitings (3 gadu)	★★★
Bāzes valūta	JPY
Daļu tips	C* (JPY)
Bloomberg kods (ticker)	SKAEQJ1 LX

Dividendes

*Fonds neizmaksā dividendes, bet tās tiek reinvestētas

Izmaksas

Pārvaldīšanas komisija*	1.50%
Cenu grupa 3	
Pirkšanas komisija filiālē vai Ibanka**:	0.75%
Pārdošanas komisija:	0%
Maņas komisija:	0%

* iekļauts daļas vērtība

** komisija netiek piemērota dzīvības apdrošināšanai ar līdzekļu uzkrāšanu

Riska novērtējums*

Standarta novirze	17.90%
Novirze no indeksa (tracking error)	2.4%
Standarta novirze raksturo fonda vērtības vēsturiskās svārstības.	
Novirze no indeksa parāda fonda vērtības svārstības attiecībā pret salīdzinošo indeksu.	

* 3 gadu rādītāji

Sadalījums pa nozarēm

Rūpniecība	25%
Finanses	17%
Ilgtermiņa lietošanas preces	17%
IT kompānijas	10%
Izejvielas	7%
Pirmās nepieciešamības preces	7%
Veselības aprūpe	6%
Telekomunikācijas	4%
Komunālie pakalpojumi	3%
Enerģētika	2%
Citi aktīvi un saistības	2%

Avots: SEB Asset Management S.A.

Valūtas ekspozīcija %

JPY	99
EUR	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 atsaucē uz kādu ieguldījumu pētījumu, iesakām izlasīt pilnu pētījumu un tajā norādītās saistību atzinas. Lūdzu, 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 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 ārvalsts 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.

