

31.12.2011. faktu ziņojums

SEB Īstermiņa obligāciju fonds EUR

SEB Short Bond Fund EUR

Fonda pārvaldīšana pamatojas uz kvantitatīvām metodēm.

Fonds investē valsts parādzīmēs un obligācijās denominētās EUR ar dzēšanas termiņu līdz vienam gadam.

Ieguldījumu filozofija

Ieguldījumu process pamatojas uz kvantitatīvo faktoru modeli, kas saglabā fonda riska un atdeves līmeni tuvu fonda salīdzinošajam indeksam. Fonda pārvaldnieks cenšas īstenot ieguldījumu pārvaldīšanu precīzi un prātīgi. Ieguldījumu procesa konsekventa un sistemātiska izstrāde un īstenošana var nodrošināt atbilstošus rezultātus ilgtermiņā.

Ieguldījumu process

Ieguldījumu fokuss

Fonds veic ieguldījumus obligācijās, parādu vērtspapiros ar mainīgu procentu likmi, valsts parādzīmēs, kā arī citos naudas tirgus instrumentos denominētus EUR. Vidējais instrumentu turēšanas laiks portfelī ir 0,12 gadi. Fonds līdz 100% no aktīviem var ieguldīt dažādos pārdamos vērtspapiros, kuru emittenti ir jebkura ES dalībvalsts vai OECD (Ekonomiskās sadarbības un attīstības organizācija) valstis. Fonds kā daļu no ieguldījumu stratēģijas var izmantot nākotnes līgumus, opcijas, mijmaiņas darījumus, kredītsaistību neizpildes mijmaiņas darījumus un citus atvasinātos finanšu instrumentus.

Ieguldījumu komanda

Fondu pārvalda Ozana Marek, pārvaldnieks ar trīs gadu pieredzi Quant & Beta komandā Stokholmā. Komandā ir augsti motivēti un profesionāli pārvaldnieki ar augstu izglītības līmeni. Komanda tika izveidota 2008. gada 1. ceturksnī. Komandai ir plaša zināšanu bāze ar spēcīgiem matemātikas un programmēšanas pamatiem.

Izpēte

Fonds izmanto konsekventu un sistemātisku ieguldījumu procesu, kas pamatojas uz kvantitatīvām metodēm. Lai sasniegtu salīdzinošā indeksa riska līmeni, fonds izmanto kvantitatīvu modeli. Kvantitatīvās pieejas mērķis ir samazināt darījumu izmaksas un uzlabot likviditāti, salīdzinot ar līdzīgu indeksa stratēģiju.

Portfeļa izveide

Fonds ir veidots ar mērķi sniegt stabilāku atdevi nekā obligāciju fondam, saglabājot tradicionālā naudas tirgus fonda īpašības, kas piesaistīs pie salīdzinošā indeksa. Salīdzinošajam indeksam ir ļoti īss vidējais termiņš līdz dzēšanai, un tam ir bijusi tikai pozitīva atdeve kopš tā izveides 2008. gada 24. novembrī.

Fonda pārvaldnieks: Marianne Gut

Nodarbinātās nozarē: 16 gadus

Pamatinformācija

Fonda tips	īstermiņa obligāciju
Reģistrācijas gads	1998
ISIN kods	LU0088160774
Daļas vērtība sākumā	1.00 EUR
Salīdzinošais indekss	Barclay Capital Euro Treasury bills 0-3 month
Fonda pārvaldošā sabiedrība	SEB Asset Management S.A.
Morningstar reitings (3 gadu)	★★
Bāzes valūta	EUR
Daļu tips	C* (EUR)
Bloomberg kods (ticker)	SEBSBEU LX

Dividendes

*Fonds neizmaksā dividendes, bet tās tiek reinvestētas

Izmaksas

Pārvaldīšanas komisija*	0.50%
Cenu grupa 1	
Pirkšanas komisija filiālē vai Ibankā:	0.00%
Pārdošanas komisija:	0%
Maiņas komisija:	0%
* iekļauts daļas vērtībā	

Riska novērtējums*

Standarta novirze	0.2
Novirze no indeksa (tracking error)	0.2
Standarta novirze raksturo fonda vērtības vēsturiskās svārstības.	
Novirze no indeksa parāda fonda vērtības svārstības attiecībā pret salīdzinošo indeksu.	
* 3 gadu rādītāji	

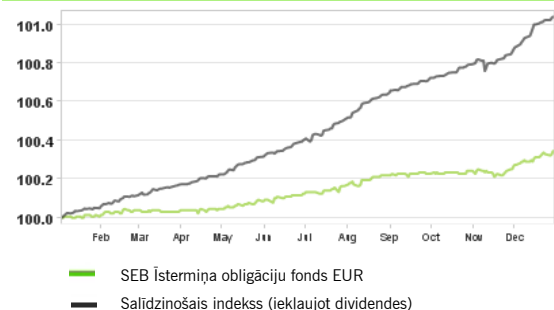
Ģeogrāfiskais sadalījums

Francija	36%
Spānija	18%
Citi aktīvi un saistības	15%
Nīderlande	13%
Beļģija	11%
Vācija	7%

Avots: SEB Asset Management S.A.

Vēsturiskie rezultāti

Kopējais fonda aktīvi (milj. EUR): 59.74 Fonda daļas vērtība EUR: 1.2728



Avots: SEB Asset Management S.A.

Lielākie ieguldījumi % no fonda aktīviem

France ffd 111110	14,1
France ffd 111027	12,7
France ffd 111215	8,5
Spain ffd 111021	7,1
Belgium ffd 111117	7,1
Spain ffd 111216	7,0
Dutch ffd 111031	5,7
Germany ffd 111123	5,7
Dutch ffd 111230	4,2
Spain ffd 111118	4,2

Avots: SEB Asset Management S.A.

Ienesīgums % EUR

Absolūtais pieaugums %

Pēdējos 3 mēnešos	0.12
Pēdējos 6 mēnešos	0.22
Pēdējā gadā	0.35
Kopš gada sākuma	0.35

Avots: www.seb.lv

Vidējais gada ienesīgums %

Pēdējos 2 gadus	0.11
Pēdējos 3 gadus	0.07
Pēdējos 4 gadus	0.53
Pēdējos 5 gadus	0.92

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 materiālā ir atsauce uz kādu ieguldījumu pētījumu, iesakām izlasīt pilnu pētījumu un tajā norādītās saistību atrunas. Lūdzu, ievērojiet, ka materiālā sniegtā informācija par nodokļiem ir balstīta uz šobrīd piemērojamiem 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 nēgarantē 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 ņemieties 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.

