

Данные на 31.12.2011.

SEB Short Bond Fund EUR

В управлении фондом используются квантитативные методы. Фонд инвестирует в государственные закладные и облигации, деноминированные в евро, со сроком погашения до 1 года.

Философия инвестиций

Инвестиции производятся на основе моделей квантитативных факторов, которые поддерживают уровень рисков и доходности, близкий к сравнительному индексу. Управляющий фондом стремится реализовать инвестиционный процесс точно и разумно. Путем дисциплинированной и систематической разработки и исполнения инвестиционного процесса с течением времени могут быть достигнуты соответствующие результаты.

Инвестиционный процесс

Инвестиционные объекты

Фонд инвестирует средства в облигации, в долговые инструменты с плавающей ставкой и в государственные векселя, а также в другие инструменты денежного рынка, деноминированные в евро. Целевая средняя продолжительность держания ценных бумаг – 0,12 года. Фонд может инвестировать до 100 % своих активов в различные ценные бумаги, выпущенные или гарантированные, любого государства-члена ЕС или ОЭСР. Фонд может использовать фьючерсные контракты, опционы, свопы, кредитные дефолтные свопы и другие производные финансовые инструменты как часть инвестиционной стратегии.

Инвестиционная команда

Озана Марек (Ozana Marek) является управляющим фондом с трехлетним опытом работы в команде Quant & Beta, находящейся в Стокгольме. Команда состоит из сотрудников, истинно преданных делу, специалистов с высоким уровнем образования. Команда основана в первой четверти 2008 года и имеет базу знаний широкого спектра, а также сильные математические основы программирования.

Исследование

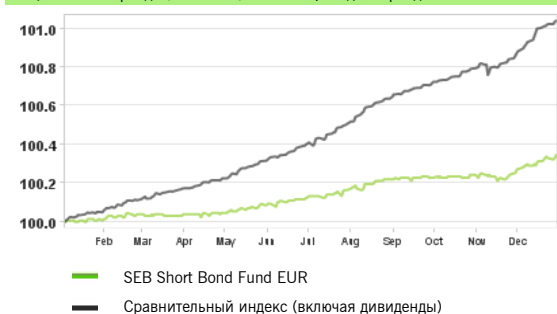
Фонд применяет дисциплинированный, систематический квантитативный процесс инвестирования, который основан на моделях квантитативных факторов, с целью соответствия уровню риска сравнительного индекса. Количественный подход направлен на снижение транзакционных издержек и повышение ликвидности по сравнению со стратегией похожего индекса.

Составление портфеля

Фонд создан с целью дать более стабильный доход, чем фонды облигаций, характеризующиеся как «традиционные» фонды денежного рынка, привязанные к сравнительному индексу. Продолжительность держания ценных бумаг сравнительного индекса очень короткая, и фонд имел положительную доходность только в рамках недели с момента его создания (* 24 ноября 2008 года).

Исторические результаты

Общие активы фонда (млн. EUR): 59.74 Цена доли фонда EUR: 1.2728



Крупнейшие вложения % от активов фонда

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

Источник: SEB Asset Management S.A.

Источник: SEB Asset Management S.A.

Доходность в % (EUR)

Абсолютная доходность в %

За последние 3 месяца	0.12
За последние 6 месяцев	0.22
За последний год	0.35
С начала года	0.35

Среднегодовая доходность в %

За последние 2 года	0.11
За последние 3 года	0.07
За последние 4 года	0.53
За последние 5 лет	0.92

Источник: www.seb.lv

Управляющий фондом: Marianne Gut

Опыт в данной отрасли 16 лет

Основная информация

Тип фонда	краткосрочных облигаций
Год регистрации фонда*	1998
ISIN код	LU0088160774
Начальная стоимость доли фонда	1.00 EUR
Сравнительный индекс	Barclay Capital Euro Treasury bills 0-3 month
Управляющая фондом компания	SEB Asset Management S.A.
Рейтинг Morningstar (за 3 года)	★ ★
Базовая валюта	EUR
Тип доли фонда	C* (EUR)
Код Bloomberg (ticker)	SEBSBEU LX

Дивиденды

*Фонд не предусматривает выплату дивидендов, а реинвестирует их

Комиссии

Комиссия за управление*	0.50%
Группа1	
Плата за покупку в филиале и Ibanka:	0%
Комиссия за продажу:	0%
Комиссия за обмен:	0%

* включено в стоимость доли фонда

Оценка риска*

Стандартное отклонение	0.2
Отклонение от индекса (tracking error)	0.2

Стандартное отклонение характеризует исторические колебания цены доли фонда.

Отклонение от индекса показывает колебания цены фонда по отношению к сравнительному индексу.

* показатели за 3 года

Географическое разделение

Франция	36%
Испания	18%
Прочие активы и пассивы	15%
Нидерланды	13%
Бельгия	11%
Германия	7%

Источник: SEB Asset Management S.A.

Валюты вложений в %

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

Источник: SEB Asset Management S.A.

Дополнительную информацию можно получить: 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 предоставленные 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 рискам. 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. В случае необходимости свяжитесь со своим консультантом по обслуживанию клиентов AS "SEB banka".

