

Amplico Subfundusz Małych i Średnich Spółek



MetLife AmplicoSM

Charakterystyka Subfunduszu

Amplico Subfundusz Małych i Średnich Spółek inwestuje głównie w akcje średnich i małych spółek notowanych na polskim rynku kapitałowym. Portfelem odniesienia do porównywania wyników inwestycyjnych Subfunduszu jest indeks mWIG40, który obrazuje zachowanie średnich spółek notowanych na GPW oraz WIBID 1M. Subfundusz w krótkim i średnim okresie może podlegać wyraźnym wahaniom cen jednostki, jednak w dłuższym okresie powinien osiągać atrakcyjne stopy zwrotu, znacznie powyżej strategii płynnościowych, a także tych, opartych na spółkach dużych. Część spółek z mWIG40 wypłaca dywidendę, co dodatkowo podnosi atrakcyjność inwestycji w ten Subfundusz.

Przedział zaangażowania w akcje może wahać się od 70% do 100% portfela Subfunduszu, natomiast ilość akcji w portfelu średnio wynosi 50-70 walorów.

Subfundusz może zawiesić przyjmowanie wpłat, jeżeli wartość jego aktywów przekroczy 600 mln PLN.

Profil inwestora

Subfundusz rekomendowany jest osobom:

- zainteresowanym inwestycjami w akcje średnich i małych spółek,
- akceptującym wysokie ryzyko inwestycyjne, które w średnim i krótkim okresie może cechować się znacznymi wahaniami ceny jednostki uczestnictwa,
- zdecydowanym na długoterminowe inwestowanie.

Podstawowe informacje o Subfunduszu i Towarzystwie

Data rozpoczęcia działalności przez TFI: 09.03.2004
Liczba strategii oferowanych przez TFI: 19
Typ Subfunduszu: Akcyjny Krajowy
Waluta bazowa: PLN
Dodatkowe waluty: brak
Region inwestowania: Polska
Benchmark: 90% mWIG40, 10% WIBID 1M
Zarządzający: Tomasz Bartnicki, Kazimierz Szpak, Wojciech Wasilewski
Data pierwszej wyceny Subfunduszu: 14.11.2006
Częstotliwość wyceny: każdy dzień roboczy GPW
Subfundusz Parasolowy: tak
Opłata dystrybucyjna (max): 4,50%
Opłata za zarządzanie (rzeczywista): 4,00%
Pierwsza wpłata: 1000 PLN
Każda następną: 500 PLN
Wielkość aktywów Subfunduszu na dzień 29.02.2012: 99 mln PLN

Poziom ryzyka



Rekomendowany okres inwestycji (w latach)

1 2 3 4 5

Zmiana wartości j.u. Amplico Subfunduszu Małych i Średnich Spółek



Alokacja sektorowa portfela akcyjnego Subfunduszu na dzień 30.06.2011

Sektor	Udział
Handel	25,0%
Przemysł	19,3%
Finanse	18,8%
Budowlany	17,7%
Telekomunikacja-IT-Media	16,2%
Paliwowo-energetyczny	3,0%

Alokacja aktywów na dzień 30.06.2011

Akcje	95,16%
Środki pieniężne	4,84%

Miary ryzyka Subfunduszu na dzień 29.02.2012

Współczynnik Sharpe'a	-0,120
Współczynnik B	1,04
Tracking Error	7,85%

5 największych pozycji portfela akcyjnego Subfunduszu na dzień 30.06.2011

INGBSK	7,4%
EMPERIA	5,7%
SYNTHOS	5,5%
BUDIMEX	4,3%
LPP	3,6%

Wyniki inwestycyjne Subfunduszu i Benchmarku na dzień 29.02.2012

	1M	3M	Od początku roku	1Y	2Y	3Y	Od początku działalności
Amplico Subfundusz Małych i Średnich Spółek	6,0%	12,5%	14,4%	-17,4%	0,1%	70,4%	-33,4%
benchmark	4,6%	12,6%	12,4%	-12,1%	7,4%	88,0%	-7,6%

Słowniczek

Beta to miara wskazująca wrażliwość zmiany ceny badanego instrumentu w porównaniu ze zmianą benchmarku, np. indeksu akcji. Wskaźnik równy jedności oznacza, że spodziewany 10% wzrost lub spadek wartości wzorca przełoży się na 10% wzrost lub spadek wartości badanego instrumentu (wartości jednostki w przypadku funduszy). Im wyższą wartość przyjmuje wskaźnik beta, tym bardziej ryzykowna jest rozpatrywana inwestycja. Ujemna beta oznacza odwrotne zachowanie się wartości jednostki w stosunku do zmiany wartości benchmarku.

Duration jest jedną z podstawowych miar oceny ryzyka portfela obligacji. Określa on ryzyko zmiany wartości portfela obligacji przy zmianie stóp procentowych. Im wyższy wskaźnik tym większe ryzyko straty w przypadku wzrostu stóp procentowych, a jednocześnie większy potencjalny zysk w przypadku obniżki stóp procentowych.

Wskaźnik Sharpe'a jest jedną z podstawowych miar oceny ryzyka funduszy. Współczynnik Sharpe'a najkrócej można zobrazować jako współczynnik premii uzyskiwanej przez inwestora w stosunku do możliwego zysku bez ryzyka. Im wyższy wskaźnik tym lepiej dla inwestora. Współczynnik Sharpe'a liczy się jako różnica stopy zwrotu portfela lub funduszu i stopy wolnej od ryzyka w stosunku do ryzyka całkowitego określane poprzez zmienność funduszu (odchylenie standardowe). Wskaźnik liczony jest w oparciu o miesięczne stopy zwrotu od momentu pierwszej wyceny funduszu, pod warunkiem, iż fundusz istnieje przynajmniej 24 miesiące.

Benchmark jest portfelem wzorcowym stanowiącym punkt odniesienia w ocenie wyników zarządzającego funduszem. W skład Benchmarku mogą wchodzić pojedyncze instrumenty finansowe, dla funduszy tzw. jednorodnych (np. funduszy akcji), bądź ich kombinacje dla funduszy mieszanych (np. funduszy zrównoważonych).

Tracking Error to wskaźnik pozwalający dokonać oceny zgodności efektów prowadzonej przez zarządzającego polityki inwestycyjnej z wynikami osiąganymi przez benchmark. Wskaźnik bazuje na odchyleniu standardowym dodatkowych stóp zwrotu (czyli sumy różnic wyników funduszu wobec wyników portfela wzorcowego/benchmarku). Im mniejsza wartość wskaźnika tym fundusz cechuje się niższym ryzykiem w stosunku do benchmarku, co oznacza niższe prawdopodobieństwo nie osiągnięcia wyniku jaki osiągnął benchmark. Wskaźnik liczony jest w oparciu o miesięczne stopy zwrotu od momentu pierwszej wyceny funduszu, pod warunkiem, iż fundusz istnieje przynajmniej 24 miesiące.

Oferta produktowa

Subfundusze Amplico Parasola Krajowego

Pieniężny

Obligacji

Aktywnej Alokacji

Stabilnego Wzrostu

Zrównoważony Nowa Europa

Akcji

Małych i Średnich Spółek

Subfundusze Amplico Parasola Światowego

Lokacyjny

Obligacji Plus

Obligacji Światowych

Zrównoważony Azjatycki

Stabilnego Wzrostu Plus

Akcji Małych Spółek

Akcji Plus

Akcji Europejskich

Akcji Nowa Europa

Akcji Rynków Wschodzących

Akcji Chińskich i Azjatyckich

Akcji Amerykańskich

Amplico Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. i Fundusze Inwestycyjne zarządzane przez Amplico Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. nie gwarantują osiągnięcia założonego celu inwestycyjnego ani uzyskania określonego wyniku inwestycyjnego.

Historyczne wyniki inwestycyjne Funduszy Inwestycyjnych nie stanowią gwarancji osiągnięcia podobnych wyników inwestycyjnych w przyszłości. Inwestycje w Fundusze Inwestycyjne są obciążone ryzykiem inwestycyjnym, włącznie z możliwością utraty przynajmniej części zainwestowanego kapitału. Indywidualna stopa zwrotu z inwestycji w dany Fundusz jest uzależniona od daty zbycia oraz odkupienia jednostek uczestnictwa, wysokości pobranych opłat manipulacyjnych oraz obowiązków podatkowych uczestnika.

Powyżej 35% wartości aktywów poszczególnych Subfunduszy Amplico FIO Parasol Krajowy oraz aktywów poszczególnych Subfunduszy Krajowych Amplico SFIO Parasol Światowy może być lokowane w papiery wartościowe emitowane, poręczane lub gwarantowane przez Skarb Państwa, Narodowy Bank Polski (nie dotyczy Amplico Subfunduszu Akcji Plus oraz Amplico Subfunduszu Akcji Małych Spółek) lub Państwo Członkowskie wskazane w statucie Amplico FIO Parasol Krajowy. Aktywa Subfunduszy Zagranicznych Amplico SFIO Parasol Światowy lokowane są w większości w jednostki uczestnictwa zagranicznych subfunduszy: PineBridge Global Funds, BlackRock Global Funds, Franklin Templeton Investment Funds, Franklin Mutual European Funds, Schroeder International Selection Fund, Baring Global Umbrella Fund oraz Invesco Funds zarządzanych przez: Pine Bridge Investment Ireland Limited, Black Rock (Luxembourg) S.A., Franklin Templeton Investors, Schroeder Investment Management, Baring Asset Management Limited oraz Invesco Management S.A.

Wartość aktywów netto Subfunduszy Amplico FIO Parasol Krajowy (nie dotyczy Amplico Subfunduszu Obligacji, Amplico Subfunduszu Pieniężnego), Subfunduszy Krajowych Amplico SFIO Parasol Światowy (nie dotyczy Amplico Subfunduszu Lokacyjnego i Amplico Subfunduszu Obligacji Plus) oraz Subfunduszy Zagranicznych Amplico SFIO Parasol Światowy (nie dotyczy Amplico Subfunduszu Obligacji Światowych) cechuje się dużą zmiennością ze względu na skład portfela inwestycyjnego Funduszu lub na stosowane techniki zarządzania tym portfelem.

Szczegółowe informacje, w tym szczegółowy opis czynników ryzyka, znajdują się w Prospekcie Informacyjnym i Skrócie Prospektu Informacyjnego Amplico SFIO Parasol Światowy oraz w Prospekcie Informacyjnym i Skrócie Prospektu Informacyjnego Amplico FIO Parasol Krajowy, dostępnych na stronie internetowej www.metlifeamplico.pl oraz u podmiotów prowadzących dystrybucję.