

Amplico Subfundusz Zrównoważony Azjatycki



MetLife AmplicoSM

Charakterystyka Subfunduszu

Amplico Subfundusz Zrównoważony Azjatycki inwestuje głównie w jednostki uczestnictwa zagranicznych funduszy inwestycyjnych zarządzanych przez PineBridge Investment Ireland Limited, oraz Franklin Templeton Investors.

Poprzez wyżej wymienione inwestycje, Subfundusz inwestuje do 50% w akcje spółek notowanych na rynkach Azji pld.-wsch. Pozostała część aktywów lokowana jest w dłużne papiery wartościowe emitowane na rynku globalnym w krajach rozwiniętych oraz w krajach gospodarek wschodzących.

Subfundusz może stosować instrumenty pochodne w celu ograniczenia negatywnego wpływu ryzyka kursowego na cenę jednostki uczestnictwa.

Profil inwestora

Subfundusz rekomendowany jest osobom:

- zainteresowanym inwestycjami w regionie Azji południowo-wschodniej,
- akceptującym średnie ryzyko inwestycyjne,
- zdecydowanym na średnioterminowe lub długoterminowe inwestowanie,
- zainteresowanym inwestycją zarówno w PLN, jak i USD.

Podstawowe informacje o Subfunduszu i Towarzystwie

Data rozpoczęcia działalności przez TFI: 09.03.2004
Liczba strategii oferowanych przez TFI: 19
Typ Subfunduszu: Mieszany Zagraniczny
Waluta bazowa: USD
Dodatkowe waluty: PLN
Region inwestowania: Azja pld.-wsch.
Benchmark: 45% PineBridge Southeast Asia Equity Fund,
22,5% Templeton Emerging Markets Bond Fund,
22,5% Templeton Global Bond Fund,
10% PLN WIBOR 1M
Zarządzający: Tomasz Bartnicki, Kazimierz Szpak,
Wojciech Wasilewski
Data pierwszej wyceny Subfunduszu: 10.01.2007
Częstotliwość wyceny: każdy dzień roboczy GPW
Subfundusz Parasolowy: tak
Opłata dystrybucyjna (max): 3,00%
Opłata za zarządzanie (rzeczywista): 2,50%
Pierwsza wpłata: 1000 PLN lub 400 USD
Każda następną: 500 PLN lub 200 USD
Wielkość aktywów Subfunduszu
na dzień 29.02.2012: 9 mln PLN

Poziom ryzyka



Rekomendowany okres inwestycji (w latach)



Zmiana wartości j.u. Amplico Subfunduszu Zrównoważonego Azjatyckiego



Alokacja geograficzna Subfunduszu na dzień 30.06.2011

Sektor	Udział
Chiny	13,6%
Korea Płd.	12,9%
Hong Kong	7,5%
Japonia	6,5%
Tajwan	6,0%
USA	4,6%
Singapur	3,7%
Rosja	2,6%
Indonezja	2,3%
Brazylia	2,2%
Pozostałe	30,2%

Alokacja aktywów na dzień 30.06.2011

PineBridge Southeast Asia Equity Fund	45,62%
PineBridge Global Emerging Markets Bond Fund	23,88%
PineBridge Global Bond Fund	23,59%
Środki pieniężne	6,90%

Miary ryzyka Subfunduszu na dzień 29.02.2012

Współczynnik Sharpe'a 0,001

Wyniki inwestycyjne Subfunduszu i Benchmarku na dzień 29.02.2012

	Waluta	1M	3M	Od początku roku	1Y	2Y	3Y	Od początku działalności
Amplico Subfundusz Zrównoważony Azjatycki	PLN	-0,9%	-2,4%	-2,3%	6,1%	15,0%	38,7%	15,8%
<i>benchmark</i>		-0,3%	-0,4%	-0,4%	9,7%	19,8%	40,6%	31,0%
Amplico Subfundusz Zrównoważony Azjatycki	USD	3,3%	8,8%	8,7%	-0,7%	9,4%	66,0%	12,8%
<i>benchmark</i>		3,1%	8,8%	8,6%	0,7%	11,9%	65,0%	25,1%

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 wzorcowy 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.