

Charakterystyka Subfunduszu

AIG Subfundusz Zrównoważony Światowy inwestuje głównie w tytuły uczestnictwa zagranicznych funduszy inwestycyjnych.

Okolo połowy portfela stanowią tytuły uczestnictwa Subfunduszu zrównoważonego światowego (AIG Balanced World Fund), a pozostała część to obligacje krajów rozwiniętych (AIG Emerging Markets Bond Fund) oraz rozwijających się (AIG Emerging Markets Bond Fund).

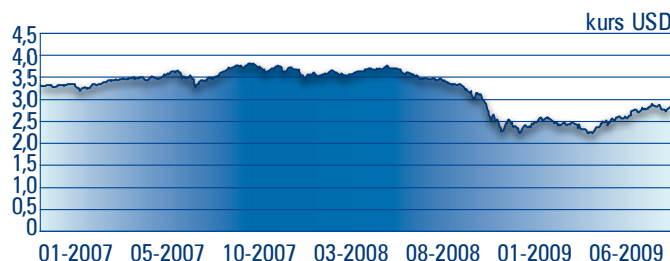
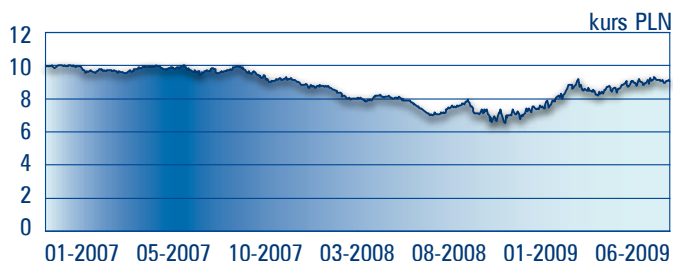
Profil inwestora

Subfundusz rekomendowany jest osobom:

- zainteresowanym globalnymi inwestycjami o średnim poziomie ryzyka zarówno w USD jak również PLN
- o średnim i długim horyzoncie inwestycyjnym.



Zmiana wartości j.u. AIG Subfunduszu Zrównoważonego Światowego



Alokacja aktywów na dzień 30.06.2009

AIG Emerging Markets Bond Fund	42%
Środki pieniężne	23%
AIG Global Emerging Markets Fund	21%
AIG Balanced World Fund	14%

Miary ryzyka Subfunduszu na dzień 30.06.2009

Współczynnik Sharpe'a -0,133

Wyniki inwestycyjne Subfunduszu i Benchmarku na dzień 30.06.2009*

	Waluta	1M	3M	Od początku roku	2009	1Y	2Y	3Y
AIG Subfundusz Zrównoważony Światowy benchmark	PLN	-0,6%	3,3%	18,4%	-	-	-	-
		-0,6%	3,1%	19,4%	-	-	-	-
AIG Subfundusz Zrównoważony Światowy benchmark	USD	-0,3%	15,3%	10,5%	-	-	-	-
		-0,4%	15,1%	11,5%	-	-	-	-

*W związku ze zmianą metodologii wycen z dniem 01.01.2009 wyniki podawane są od tej daty.

Podstawowe informacje o Subfunduszu i Towarzystwie

Data rozpoczęcia działalności przez TFI: 09.03.2004
 Liczba strategii oferowanych przez TFI: 19
 Typ Subfunduszu: Dłużny Zagraniczny
 Waluta bazowa: USD
 Dodatkowe waluty: PLN
 Region inwestowania: Świat
 Benchmark: 45 % AIG Balanced World Fund + 22,5% AIG Emerging Markets Bond Fund + 22,5% AIG Global Emerging Markets Fund + 10% USD LIBOR 1M - 0,2%

Zarządzający: Olgierd Chodyniecki
 Data pierwszej wyceny Subfunduszu: 10.01.2007
 Częstotliwość wyceny: każdy dzień roboczy GPW
 Fundusz Parasolowy: tak
 Opłata dystrybucyjna (max): 3,00%
 Opłata za zarządzanie (rzeczywista): 2,50%
 Pierwsza wpłata: 1000 PLN lub 400 USD
 Każda następna: 500 PLN lub 200 USD
 Wielkość aktywów Subfunduszu na dzień 30.06.2009: 5 mln PLN

Beta

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.

Wskaźnik Sharpe'a

Współczynnik 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.

Tracking Error

Wskaźnik Tracking Error pozwala 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.

Duration

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.

Benchmark

Portfel wzorcowy stanowiący 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).

AIG Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. z siedzibą w Warszawie, ul. Przemysłowa 26, 00-450 Warszawa, zarejestrowane przez Sąd Rejonowy dla m.st. Warszawy, XII Wydział Gospodarczy Krajowego Rejestru Sądowego, pod nr KRS 0000181644; NIP 107-000-00-46; wysokość kapitału zakładowego: 17.190.000,00 złotych, wpłacony w całości.

AIG Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. i Fundusze Inwestycyjne zarządzane przez AIG Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. nie gwarantują osiągnięcia założonego celu inwestycyjnego ani uzyskania określonego wyniku inwestycyjnego. Prezentowane wyniki inwestycyjne AIG Funduszy Inwestycyjnych są historycznymi wynikami inwestycyjnymi Funduszy Inwestycyjnych i nie stanowią gwarancji osiągnięcia podobnych wyników inwestycyjnych w przyszłości. Wyniki te zostały ustalone dla jednostki typu A. 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 AIG Funduszy Inwestycyjnych Otwartych oraz aktywów poszczególnych Subfunduszy Krajowych AIG Specjalistycznego Funduszu Inwestycyjnego Otwartego Parasol Światowy może być lokowane w papierze wartościowe emitowane, poręczane lub gwarantowane przez Skarb Państwa, Narodowy Bank Polski (nie dotyczy AIG FIO Akcji i AIG Subfunduszu Akcji) lub Państwo Członkowskie wskazane w statucie poszczególnych AIG Funduszy Inwestycyjnych Otwartych. Aktywa Subfunduszy Zagranicznych AIG SFIO Parasol Światowy lokowane są w większości w jednostki uczestnictwa AIG Global Funds. Wartość aktywów netto AIG FIO Akcji, AIG FIO Małych i Średnich Spółek, AIG FIO Zrównoważony Nowa Europa, AIG FIO Aktywnej Alokacji i AIG FIO Stabilnego Wzrostu oraz Subfunduszy Krajowych AIG SFIO Parasol Światowy (nie dotyczy AIG Subfunduszu Pieniężnego i AIG Subfunduszu Obligacji) 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 AIG SFIO Parasol Światowy oraz w Prospekcie Informacyjnym i Skrócie Prospektu Informacyjnego AIG Funduszy Inwestycyjnych Otwartych, dostępnych na stronie internetowej <http://www.aigfundusze.pl/> oraz u podmiotów prowadzących dystrybucję. AIG Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. nie ponosi odpowiedzialności za jakiegokolwiek szkody powstałe w wyniku korzystania bądź niemożności korzystania z materiałów zamieszczonych na niniejszej stronie internetowej. AIG Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. zastrzega sobie prawo do dokonywania zmian w treści zawartych informacji bez wcześniejszego powiadomienia.