

30.09.2017

Τριμηνιαίο Ενημερωτικό Δελτίο – Fact Sheet

Κατηγορία Ομολογιακό
Έναρξη / Αλλαγή Κατηγορίας 27 Μαρτίου 2008
Καθαρό Ενεργητικό EUR 2.525.616
Καθαρή Τιμή EUR 4,2637
Κωδικός Bloomberg MARPFBF GA Equity
Θεματοφύλακας Τράπεζα Πειραιώς
Νόμισμα Αποτίμησης Ευρώ
Ελάχιστο Ποσό Επένδυσης € 1.000
Προμήθεια Διάθεσης¹ €0 - €30.000 0,40% €30.001 - €100.000 0,30% > €100.000 0,15%
Προμήθεια Εξαγοράς 0,00%
Αμοιβή Διαχείρισης² 1,25% ετησίως
Benchmark – Δείκτης Αναφοράς 100% Barclays Euro Aggregate
Επενδυτικός Κίνδυνος Μεσαίος
Προτεινόμενη Διάρκεια Επένδυσης Μακροπρόθεσμη (3 Έτη)
Ημερήσιο VAR Χαρτοφυλακίου (99%) 0,27%
Ημερήσιο VAR Benchmark (99%) 0,43%

Σημειώσεις
1. Οι κλιμακικές ποσών υπολογίζονται αθροίζοντας το ενεργό χαρτοφυλάκιο του πελάτη σε όλα τα Α/Κ της CPB Asset Management και το ποσό της νέας συμμετοχής
2. Ετησίως, επί του μέσου καθαρού ενεργητικού του Α/Κ

Επενδυτικός Σκοπός

Σκοπός του Α/Κ είναι η επίτευξη της καλύτερης δυνατής απόδοσης βάσει της επενδυτικής του πολιτικής, σε μακροπρόθεσμο ορίζοντα, που προέρχεται πρωτίστως από εισόδημα και δευτερευόντως από υπεραξία, μέσω επενδύσεων σε κινητές αξίες και μέσα χρηματαγοράς, διαπραγματεύσιμα στις διεθνείς αγορές σταθερού εισοδήματος.

Επενδυτική Πολιτική

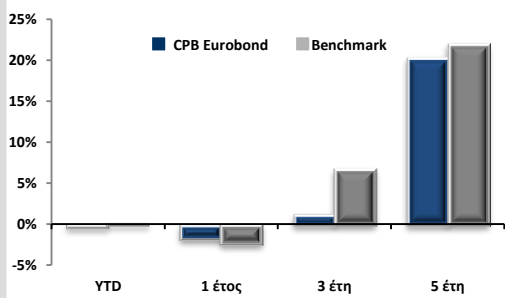
Για την υλοποίηση του σκοπού του, το Α/Κ προτίθεται να τοποθετεί το μεγαλύτερο μέρος των επενδύσεων του σε ένα διαφοροποιημένο χαρτοφυλάκιο χρωστικών τίτλων, δηλαδή σε κρατικά και εταιρικά ομόλογα, σταθερού ή/ και κυμαινόμενου επιτοκίου, έντοκα γραμμάτια δημοσίου και λοιπά συναφή χρεόγραφα, διαπραγματεύσιμα σε αγορές της Ευρωζώνης. Έμφαση δίνεται στην επιλογή εκδοτών οι οποίοι είναι διαβαθμισμένοι επενδυτικά (Investment Graded). Τέλος, το Α/Κ αποσκοπεί στην καλύτερη δυνατή εκμετάλλευση των χρηματικών του διαθεσίμων, με την επένδυσή τους σε τοκοφόρες τοποθετήσεις με τη μορφή προθεσμιακών καταθέσεων και λοιπών συναφών μέσων χρηματαγοράς. Στα πλαίσια της μόχλευσης του χαρτοφυλακίου ή/και της αντιστάθμισης στοιχείων του ενεργητικού του, το Α/Κ δύναται να λαμβάνει θέσεις αγοράς ή πώλησης σε παράγωγα χρηματοοικονομικά προϊόντα, κυρίως επί ομολόγων.

Που απευθύνεται

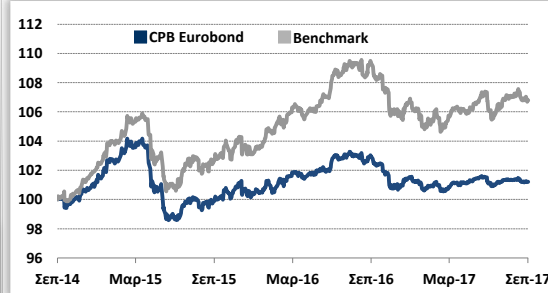
Το Α/Κ απευθύνεται κυρίως σε μακροπρόθεσμους επενδυτές που επιθυμούν εισόδημα, μέσω ενός ομολογιακού χαρτοφυλακίου που αποτελείται κυρίως από εκδόσεις κρατών και εταιρειών της Ευρωζώνης και είναι διατεθειμένοι να αναλάβουν μεσαίο επιπέδο επενδυτικό κίνδυνο.

Σωρευτικές Αποδόσεις Α/Κ vs. Benchmark

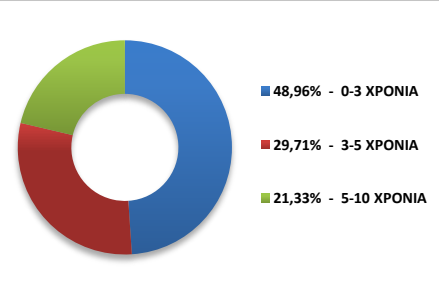
ΧΡΟΝΙΚΗ ΠΕΡΙΟΔΟΣ (ΗΜ. ΑΝΑΦΟΡΑΣ 30/09/2017)	CPB EUROBOND	BENCHMARK	ACTIVE RETURN
ΥΤΔ	-0,28%	0,13%	-0,41%
1 ΕΤΟΣ	-1,67%	-2,29%	0,62%
3 ΕΤΗ	1,20%	6,79%	-5,59%
5 ΕΤΗ	20,19%	21,95%	-1,76%



Σωρευτική Απόδοση Ζετίας (30/09/14 – 30/09/17) Α/Κ vs. Benchmark



Κατανομή Επενδύσεων Βάσει Ληκτότητας Ομολόγων

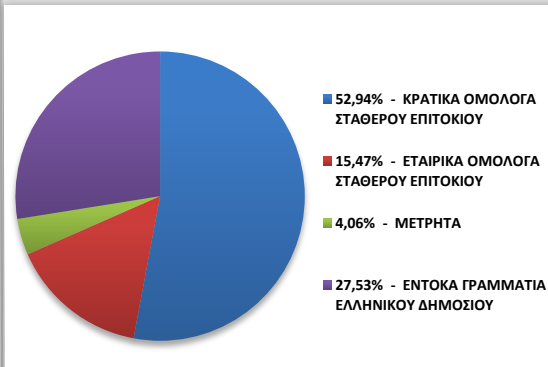


CPB ASSET MANAGEMENT Α.Ε.Δ.Α.Κ.
Αρ. Γ.Ε.ΜΗ. : 003581901000
Απόφαση ΔΣ Ε.Κ. : 7/175/9-11-1999
Έδρα : Αμερικής 6, Τ.Κ. 106 71, Αθήνα
Τηλ. : 213 0101200 Φαξ : 210 6898390
E-mail : info@cpbaedak.gr Web : www.cpbaedak.gr

Τμήμα Εξυπηρέτησης Μεριδιούχων
Παυλίδου Μ. : 213 0101222
Καβουροπούλου Ε. : 213 0101200

Τμήμα Διαχείρισης Χαρτοφυλακίων Α/Κ
Παναγιωτάκης Α. : apanagiotakis@cpbaedak.gr
Λεβαντής Α. : alevantis@cpbaedak.gr
Φιλιππίδου Σ. : sfilippidou@cpbaedak.gr

Διάρθρωση Χαρτοφυλακίου



Μεγαλύτερες Θέσεις

HELLENIC T-BILL 09/08/17 - 10/11/17	0%	7,90%
HELLENIC T-BILL 13/09/17 - 15/12/17	0%	7,89%
BELGIUM 16/05/06 - 28/03/22	4% FXD	4,73%
SPANISH 22/01/14 - 30/04/24	3.80% FXD	4,72%
AUSTRIA 19/01/12 - 22/11/22	3.40% FXD	4,69%
ASML HOLDING 12/09/13-19/9/23	3.375% FXD	4,58%
NETHERLANDS 12/01/11 - 15/07/21	3.25% FXD	4,52%
TELECOM IT 19/09/13-25/09/20	4.875% FXD	4,49%
OBRIGACOES 16/02/05-15/04/21	3.85% FXD	4,44%
FRANCE 28/09//12-25/10/22	2.25% FXD	4,43%