

Amplico Subfundusz Akcji Rynków Wschodzących

Lipiec 2010

Charakterystyka Subfunduszu

Amplico Subfundusz Akcji Rynków Wschodzących inwestuje głównie w tytuły uczestnictwa zagranicznych funduszy inwestycyjnych.

Około połowy portfela stanowią tytuły uczestnictwa Subfunduszu inwestującego w Regionie Azji Płd.-Wsch. (PineBridge South East Asia Fund), pozostała część inwestowana jest w Regionie Europy Śrd.Wsch. (PineBridge Emerging Europe Equity Fund) i Ameryce Łacińskiej (PineBridge Latin America Fund).

Profil inwestora

Subfundusz rekomendowany jest osobom:

- zainteresowanym globalnymi inwestycjami na najdynamiczniej rozwijających się rynkach Krajów Wschodzących,
- akceptującym wysokie ryzyko inwestycyjne,
- o długim horyzoncie inwestycyjnym.

Poziom ryzyka

wysoki

Podstawowe informacje o Subfunduszu i Towarzystwie

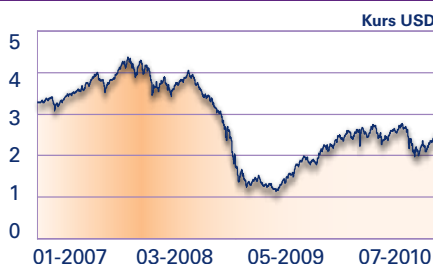
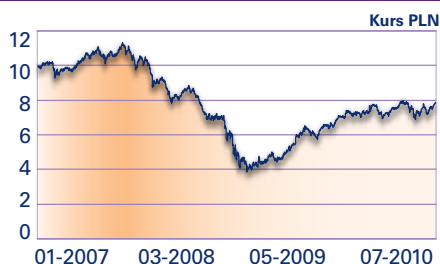
Data rozpoczęcia działalności przez TFI: 09.03.2004
 Liczba strategii oferowanych przez TFI: 19
 Typ Subfunduszu: Akcyjny Zagraniczny
 Waluta bazowa: USD
 Dodatkowe waluty: PLN
 Region inwestowania: Świat
 Benchmark: 45% PineBridge South East Asia Fund + 27% PineBridge Emerging Europe Equity Fund + 18% PineBridge Latin America Fund + 10% USD LIBOR 1M-0,2%
 Zarządzający: Dariusz Nawrot

Data pierwszej wyceny Subfunduszu: 10.01.2007
 Częstotliwość wyceny: każdy dzień roboczy GPW
 Subfundusz Parasolowy: tak
 Oplata dystrybucyjna (max): 4,00%
 Oplata za zarządzanie (rzeczywista): 3,00%
 Pierwsza wpłata: 1000 PLN lub 400 USD
 Każda następna: 500 PLN lub 200 USD
 Wielkość aktywów Subfunduszu na dzień 30.07.2010: 38 mIn PLN

Rekomendowany okres inwestycji (w latach)

1 2 3 4 5

Zmiana wartości j.u. Amplico Subfunduszu Akcji Rynków Wschodzących



Alokacja aktywów na dzień 31.12.2009

PineBridge South East Asia Fund 44%
 PineBridge Emerging Europe Equity Fund 27%
 PineBridge Latin America Fund 18%
 Środki pieniężne 11%

Alokacja geograficzna Subfunduszu na dzień 30.06.2010

Sektor	Udział
Rosja	16,2%
Chiny	12,2%
Brazylia	11,0%
Korea Płd.	9,5%
Hong Kong	6,8%
Tajwan	6,2%
Turcja	4,6%
Singapur	4,4%
Meksyk	4,0%
Polska	3,1%
Pozostałe	8,6%

Miary ryzyka Subfunduszu na dzień 30.07.2010

Współczynnik Sharpe'a -0,082

Wyniki inwestycyjne Subfunduszu i Benchmarku na dzień 30.07.2010*

	Waluta	1M	3M	Od początku roku	2009	1Y	2Y	3Y
Amplico Subfundusz Akcji Rynków Wschodzących	PLN	7,8%	0,4%	4,4%	76,7%	19,3%	-	-
benchmark		-1,2%	2,2%	8,1%	72,1%	23,3%	-	-
Amplico Subfundusz Akcji Rynków Wschodzących	USD	19,1%	-4,3%	-3,2%	83,6%	14,7%	-	-
benchmark		9,2%	-2,5%	0,3%	78,8%	18,5%	-	-

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

Amplico

Fundusze Inwestycyjne

Słowniczek

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.

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.

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.

Benchmark

Portfel wzorcowy stanowiący punkt odniesienia w ocenie wyników zarządzającego funduszem. W skład Benchmarku mogą wchodzić pojedyncze instrumenty finansowe, dla funduszy tzw. jednostkowych (np. funduszy akcji), bądź ich kombinacje dla funduszy mieszanych (np. funduszy zrównoważonych).

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.

Amplico 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.

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 i Amplico Subfunduszu Akcji Plus) lub Państwo Członkowskie wskazane w statucie Amplico FIO Parasol Krajowy. Aktywa Subfunduszy Zagranicznych Amplico SFIO Parasol Światowy lokowane są w większości w jednostki uczestnictwa PineBridge Global Funds, Amplico Subfunduszu Surowcowego w jednostki uczestnictwa zagranicznych subfunduszy wymienionych w statucie zarządzanych przez Morgan Stanley oraz Fortis Investment, a Amplico Subfundusz Akcji Europejskich w BlackRock Global Funds – European Focus Fund i Franklin Templeton Investment Funds – Franklin Mutual European Fund.

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 Pieniężnego Plus 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 <http://www.Amplicofundusze.pl/> oraz u podmiotów prowadzących dystrybucję.