

Porträt

SEB Asset Selection

SEB ASSET MANAGEMENT

August 2011

Selektion im Zeichen der Märkte

Zeichen erkennen und rechtzeitig handeln – Veränderungen der Märkte durch Anpassung der Positionierung in den vier Anlageklassen Aktien, Anleihen, Währungen und Rohstoffe aufgreifen. Das ist das Erfolgskonzept hinter diesem Fonds.



Der Name SEB Asset Selection steht für eine Produktfamilie, die nicht wie so oft aus der Entwickler-, sondern aus der Anwenderperspektive aufgelegt wurde. Aufgestellt als Total-Return-Produkte, versucht der Fondsmanager unabhängig davon, ob die Märkte steigen oder fallen, einen Kapitalzuwachs zu erzielen. Die Fonds schöpfen dabei aus Renditequellen verschiedener Asset-Klassen, was jedoch weit über einen klassischen Mischfonds hinausgeht.

Flexibilität

Das Fondsmanagement fokussiert sich auf die wichtigen Allokationsentscheidungen zwischen und innerhalb der Asset-Klassen Aktien, Anleihen, Währungen und Rohstoffe. Dabei gibt es keine vorher festgelegten, fixen Gewichtungen.

Durch den Einsatz von Derivaten werden positive wie negative Anteile in den einzelnen Anlageklassen gehalten, um so Marktzyklen gezielt auszunutzen und von steigenden wie fallenden Märkten profitieren zu können. Dabei wird stets das Risikobudget im Auge behalten. Als Grundlage dient das Basisportfolio aus Geldmarktpapieren.

Mit der Investition in hochliquide Futures ist eine schnelle Reaktionsfähigkeit auf die Veränderungen an den verschiedenen Märkten gegeben.

Modell im Einsatz

„Herzstück“ der Fonds ist ein eigens entwickeltes quantitatives Modell, das – frei von jeglichen Benchmarkvorgaben – die optimale Asset Allokation bestimmt. Das Modell basiert auf fundamentalen, technischen und verhaltensorientierten Faktoren und liefert dem Fondsmanagement täglich Signale.

Klare Vorgaben des Risikoniveaus

Vorab definierte angestrebte Renditen im Vergleich zum risikolosen Zins (1-Monats-Euribor) machen die Beurteilung der Fondsmanager-Leistung einfach! Zudem existieren eindeutige Ziele hinsichtlich der Risikoniveaus.

Investmentphilosophie

- Märkte zeigen Ineffizienzen und bieten die Möglichkeit zur Generierung von Überrenditen.
- In einer sich ständig wandelnden Welt ist die Abbildung und Analyse von Veränderungen der entscheidende Erfolgsfaktor zur Erwirtschaftung von Überrenditen.
- Mithilfe quantitativer Methoden kann eine breite Datenbasis effizient ausgewertet und können wertschöpfende Faktoren identifiziert werden.
- Der Einsatz quantitativer Methoden verhindert Fehler aufgrund verhaltenstheoretisch bedingter Fehleinschätzungen.

Anlageuniversum

Index-Futures: Aktien-Futures, Währungs-Futures, Renten-Futures, Rohstoff-Futures

Andere: Währungs-Forwards, ETF's und andere Instrumente



Porträt

SEB Asset Selection

SEB ASSET MANAGEMENT



August 2011

Investmentprozess



Chancen

- Alle Allokations- und Timingentscheidungen werden vom Fondsmanagement übernommen.
- Total-Return-Charakteristik
- Erfolgreiches, diszipliniertes und eingespieltes Managementteam arbeitet seit 2003 zusammen
- Großes Anlageuniversum mit Investitionsmöglichkeiten in Aktien, Anleihen, Währungen und Rohstoffen über alle Länder und Sektoren hinweg

Risiken

- Wertschwankungen sind möglich und können das Anlageergebnis beeinflussen.
- Die niedrige Zahlung, die normalerweise zur Begründung einer Derivate-Position erforderlich ist, erlaubt einen hohen Grad an Hebelwirkung.
- Die Entwicklung der Kapitalmärkte hängt von der allgemeinen Lage der Weltwirtschaft, den wirtschaftlichen und den politischen Rahmenbedingungen in den jeweiligen Ländern ab.
- Das Marktzinsniveau kann sich ändern, daraus können sich Kursänderungen der festverzinslichen Wertpapiere im Portfolio ergeben.

Eine Strategie – Drei Fonds

Die SEB Asset Selection Fondsfamilie bietet drei Fonds mit unterschiedlichen Risikoprofilen und Renditeerwartungen. Dabei werden die Risiko- und Renditeziele als jährlicher Durchschnitt über einen Zeitraum von drei bis fünf Jahren betrachtet. Alle Fonds verfolgen die gleiche Strategie und halten grundsätzlich die gleichen Positionen – diese unterscheiden sich allerdings in ihrer Größe.

Stammdaten und Fondsinformationen

	SEB Asset Selection Defensive	SEB Asset Selection Fund	SEB Asset Selection Opportunistic
Renditeziel:	Barclays Euro Treasury Index 0-6 Monate + 2 % p.a.	Barclays Euro Treasury Index 0-6 Monate + 5 % p.a.	Barclays Euro Treasury Index 0-6 Monate + 10 % p.a.
Risikoziel:	5 % Volatilität p.a.	10 % Volatilität p.a.	20 % Volatilität p.a.
ISIN:	LU0425992988	LU0256624742	LU0425994844
WKN:	AONGH5	A0J4TG	AONGJJ
Fondswährung:	EUR	EUR	EUR
KAG:	SEB Asset Management S.A.	SEB Asset Management S.A.	SEB Asset Management S.A.
Auflage:	04.06.2009	03.10.2006	04.11.2009
Geschäftsjahr:	01.01.–31.12.	01.01.–31.12.	01.01.–31.12.

* max. 0,5 % des Fondsvolumens

Dieses Dokument stellt eine allgemeine Marketingmitteilung dar. Die in diesem Dokument enthaltenen Informationen werden ausschließlich zu Informationszwecken zur Verfügung gestellt und stellen weder ein Angebot zum Kauf oder Verkauf noch eine Aufforderung zur Abgabe eines Angebots zum Kauf oder Verkauf des dargestellten Produkts dar. Dieses Produkt kann nicht von US-Personen erworben werden. Alleinverbindliche Grundlage für den Erwerb von Investmentanteilen ist der jeweils gültige Verkaufsprospekt in Verbindung mit dem jeweils letzten Jahres- und / oder Halbjahresbericht des Fonds beziehungsweise die wesentlichen Anlegerinformationen. Diese Unterlagen können Sie kostenlos in deutscher Sprache direkt über das Internet oder Ihren Berater / Vermittler erhalten. Beratungsleistungen werden von SEB Asset Management AG nicht erbracht und die Informationen, die in dieser Präsentation enthalten sind, stellen keine Anlageberatung dar. Anlagen in Fonds sind sowohl mit Chancen als auch mit Risiken verbunden. Der Marktwert einer Anlage kann sowohl steigen als auch fallen. In der Vergangenheit erzielte Renditen und Wertentwicklungen bieten keine Gewähr für die Zukunft; in manchen Fällen können Verluste den ursprünglich investierten Betrag übersteigen. Der Inhalt dieses Dokuments stammt aus öffentlich zugänglichen Quellen, die als verlässlich angesehen werden. Für die Richtigkeit und Vollständigkeit der Informationen kann jedoch keine Gewähr übernommen werden. Der Erwerb dieses Produktes ist mit Kosten / Gebühren verbunden. Der Ausgabeaufschlag stellt im Wesentlichen eine Vergütung für den Vertrieb der Anteile des Sondervermögens dar. Die Gesellschaft gewährt Vermittlern, z. B. Kreditinstituten, wiederkehrend – meist jährlich – Vermittlungsentgelte als so genannte „laufende Vertriebsprovisionen“.

SEB Asset Management AG, Rotfeder-Ring 7, 60327 Frankfurt am Main,
Infoline: 0180 1 777 999 (dt. Festnetz 0,039 EUR/Minute; Mobilfunk max. 0,42 EUR/Minute), www.sebassetmanagement.de, E-Mail: info@sebam.de