

Credit Suisse Fund (Lux) Relative Return Engineered (Sfr)

Třída B

Investiční politika

Investičním cílem fondu je překonat výnos benchmarku na rizikově očištěném základě. Fond synteticky replikuje rizikové výnosové vlastnosti tradičních dluhopisových investic (úrokové sazby, kredit a riziko) za použití standardních derivátů. Díky velmi likvidním trhům a nízkým transakčním nákladům fond dosahuje vysokého stupně flexibility v implementaci své strategie. Investiční strategie zahrnuje aktivní pozici durace, splatnosti a kreditního rizika vůči benchmarku. Rizikové výnosový profil fondu je podobný tradičnímu dluhopisovému fondu.

Základní údaje

Manažer fondu	Daniele Paglia
Manažer fondu od	04/06/2007
Sídlo	Curych
Sídlo fondu	Lucembursko
Měna fondu	CHF
Konec finančního roku	30. září
Celkem vl. kapitál (v. mil.)	193.06
Primární emise	08/06/2007
Úplata za obhospodarování v % p.a.	1.00
TER (budoucí) v %	1.21
Benchmark (BM)	SBI Foreign AAA-BBB (RI)
Třída aktiv	Kategorie B (reinvestiční)
Měna podílových listů	CHF
ISIN	LU0230912676
Bloomberg ticker	CRRRESB LX
Hodnota podílového listu	117.10
Odprodeje	Denně
Zdanění v EU	Mimo oblast působnosti

Čistá výkonnost v CHF (normováno ke 100) ¹⁾



Celková výkonnost: výkonnost zahrnující interní náklady.

Relativní výkonnost: kromě interních nákladů fondu je zahrnuto rovněž maximální emisní ážio 5.00 %. Poplatky za správu úschovniho účtu nejsou zahrnuty; jejich zahrnutí by mělo negativní dopad na výsledek

Čistá výkonnost v CHF ¹⁾

	1 měsíc	3 měsíce	YTD	1 rok	3 roky	5 let
Fond	-0.40	1.60	1.60	4.83	8.85	-
Benchmark	0.42	2.45	2.45	5.25	19.93	-

Měna v %

	před zajištěním	po zajištění
USD	91.71	-
CHF	3.68	100.00
EUR	2.75	-
AUD	0.41	-
CAD	0.31	-
DKK	0.26	-
GBP	0.24	-
HKD	0.18	-
NOK	0.13	-
Others	0.33	0.00

Kreditní rating v %

AA	44.08
A	6.22
A-	9.32
BBB+	40.38

Podkladová portfolia

Hotovost	3.43
Hedged equities idx futures	9.28
Hedged equities forwards	87.29

Durace a výnos

Modifikovaná durace (roky)	4.32
----------------------------	------

Statistika fondu

	1 rok	3 roky
Anualizovaná volatilita v %	1.71	1.78
Informační poměr	-0.16	-1.51
Tracking Error (Ex post)	2.46	2.13
Maximální propad v % ²⁾	-0.40	-2.20

²⁾ Maximální ztráta je nejnižší záporná výkonnost v průběhu určitého období.

Kontakt

WOOD & Company investiční společnost, a.s.
 Náměstí Republiky 1079/1a, Praha 1
 fondy@wood.cz
 Bezplatná infolinka: 800 1 27 27 2

¹⁾ Historický vývoj nezahrnuje obdobné výsledky do budoucna. Ukazatel výkonnosti nezahrnuje poplatky spojené s úpisy a zpětnými odkupy podílových listů.

Tento dokument vytvořila společnost Credit Suisse AG nebo její pobočky (dále jen jako „CS“) s maximální péčí a podle svého nejlepšího vědomí a svědomí. Nicméně CS tímto neposkytuje žádnou záruku vztahující se k jeho obsahu a úplnosti a nepřijímá žádnou odpovědnost za ztráty, které mohou z použití informací v něm obsažených vzniknout. Názory vyjádřené v tomto dokumentu jsou názory CS v době, kdy byl dokument sepsán, a mohou být kdykoli bez předchozího upozornění změněny. Není-li uvedeno jinak, všechna čísla jsou neauditovaná. Tento dokument slouží pouze k informačním účelům a je určen pouze příjemci k jeho výhradnímu použití. Nepředstavuje nabídku ani doporučení k nákupu či prodeji finančních instrumentů či bankovních služeb a nezbavuje příjemce nezbytností vycházet z vlastního úsudku. Příjemci především doporučujeme, aby si případně i s pomocí odborného poradce prověřili, zda zde uvedené informace odpovídají jeho situaci s ohledem na právní, regulační, daňové či jiné důsledky. Bez písemného souhlasu CS je zakázáno jakoukoli část tohoto dokumentu či celý dokument kopírovat. Výslovně není určen osobám, jež z důvodu národnosti či místa bydliště nemají na základě lokálních zákonů oprávnění k přístupu k těmto informacím. Je zakázáno tento dokument či jeho kopie poslat, přivést nebo šířit v USA šířit, stejně tak je zakázáno je poslat či přivést jakémukoliv americkému občanovi (ve smyslu nařízení S zákona USA o cenných papírech z roku 1933 v jeho aktuálně platném znění). Všechny investice představují riziko především ve vztahu k fluktuaci hodnoty a návratnosti. Investice do cizích měn představují riziko navíc v podobě ztráty hodnoty cizí měny ve vztahu k referenční měně investora. Údaje o historických výsledcích a scénáře situace na finančních trzích nejsou zárukou aktuálních ani budoucích výsledků. Údaje o výsledcích neberou v úvahu provize účtované při úpisu či vyplacení. Dále nelze zaručit, že srovnávací ukazatel (benchmark) dosáhne stejných výsledků nebo že budou jeho výsledky překonány. V souvislosti s tímto investičním produktem mohou emitent anebo jeho příčleněné subjekty uhradit jiným subjektům odměnu či od jiných subjektů získat odměnu například v rámci kompenzace, a to jednorázově či opakovaně (např. odměna za prodej či tzv. holding fee). O další informace můžete požádat banku/manažera vztahů se zákazníky. Nelze vyloučit případný konflikt zájmů. Tento dokument má podobu marketingového materiálu zveřejněného pro reklamní účely. Nelze jej chápat jako nezávislý výzkum. Cenné papíry prezentované v této publikaci nepodporuje švýcarská burza SIX Swiss Exchange, nejsou pod ni přiřazeny, neprodává je ani je nepropaguje. Tímto je odmítnána veškerá odpovědnost. SMI®, SMIM®, SLI®, SBI® a příslušné indexy jsou registrovanými obchodními známkami burzy SIX Swiss Exchange a mohou být používány pouze na základě licence udělené vlastníkem. Investiční fondy zmíněné v této publikaci byly založeny v souladu s lucemburským zákonem jako fondy kolektivního investování do převoditelných cenných papírů (UCITS) podléhající směrnici EU 2009/65/ES v platném znění. Úpisy platí pouze na základě stávajícího prodejního prospektu, zjednodušeného prospektu nebo dokumentu s informacemi o klíčovém investorovi (pokud byl jmenován) a nejaktuálnější výroční zprávy (či pololetní zprávy, pokud je bližšího data). Tyto dokumenty a předpisy nebo podmínky pro správu fondů lze získat zdarma v angličtině od společnosti Wood & Company investiční společnost, Náměstí Republiky 1079/1a, Praha 1. Ukazatel Total Expense Ratio (TER) je součtem veškerých poplatků a nákladů pravidelně účtovaných ve vztahu k průměrným aktivům fondu (provozní výdaje). Jeho hodnota (ex ante) se udává v procentech majetku fondu a slouží jako projekce průměrného výsledku za následujících dvanáct měsíců za stejných podmínek.