

Credit Suisse Fund (Lux) Total Return Engineered (Euro)

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.

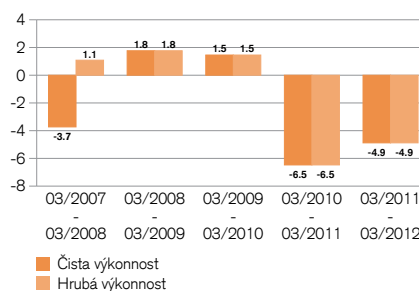
Základní údaje

Manažer fondu	Daniele Paglia
Manažer fondu od	20/03/2006
Sídlo	Curych
Sídlo fondu	Lucembursko
Měna fondu	EUR
Konec finančního roku	30. září
Celkem vl. kapitál (v. mil.)	11.04
Primární emise	24/03/2006
Úplata za obhospodarování v % p.a.	1.20
TER (budoucí) v %	1.41
Benchmark (BM)	LIBOR EUR 3M
Třída aktiv	Kategorie B (reinvestiční)
Měna podílových listů	EUR
ISIN	LU0230914029
Bloomberg ticker	CSTREEB LX
Hodnota podílového listu	94.16
Odprodeje	Denně
Zdanění v EU	Mimo oblast působnosti

Čistá výkonnost v EUR (normováno ke 100) ¹⁾



Zdroj: Lipper, a Reuters Company



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 výsledky

Čistá výkonnost v EUR ¹⁾

	1 měsíc	3 měsíce	YTD	1 rok	3 roky	5 let
Fond	-0.15	-0.01	-0.01	-4.88	-9.74	-7.15
Benchmark	0.07	0.27	0.27	1.35	3.12	12.31

Měna v %

	před zajištěním	po zajištění
USD	91.74	-
EUR	6.20	100.00
AUD	0.40	-
CAD	0.32	-
CHF	0.25	-
DKK	0.25	-
GBP	0.23	-
HKD	0.17	-
NOK	0.12	-
Others	0.32	0.00

Kreditní rating v %

AA	100.00
----	--------

Rozložení aktiv v %

Akcie (a akciové typy cenných papírů)	98.63
Otevřené fondy	1.37
Celkem	100.00

Podkladová portfolia

Hotovost	3.68
Hedged equities idx futures	8.95
Hedged equities forwards	87.37

Durace a výnos

Modifikovaná durace (roky)	0.00
----------------------------	------

Statistika fondu

	3 roky	5 let
Annualizovaná volatilita v %	2.88	2.69
Informační poměr	-1.53	-1.45
Tracking Error (Ex post)	2.89	2.62
Maximální propad v % ²⁾	-11.55	-11.55

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 úpisem 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 nezbytnosti 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. 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 neaktuálnější 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.