ALPHA ASSET MANAGEMENT Α.Ε.Δ.Α.Κ.

Alpha (LUX) Global Defensive ESG FoF EUR

31 Ιανουαρίου 2024

Επενδυτικός Σκοπός και Πολιτική

Επενδυτικός σκοπός του Υπό-Αμοιβαίου Κεφαλαίου είναι η επίτευξη συνολικής απόδοσης από αύξηση κεφαλαίου και εισόδημα σε μεσομακροπρόθεσμο ορίζοντα, μέσω των επενδύσεών του κυρίως σε μερίδια ή μετοχές ΟΣΕΚΑ ή άλλων οργανισμών συλλογικών επενδύσεων, προσφέροντας έκθεση σε ένα συντηρητικού προφίλ διεθνές χαρτοφυλάκιο κατανομής περιουσίας.

Για την επίτευξη του σκοπού του, το Υπό-Αμοιβαίο Κεφάλαιο επενδύει κυρίως σε ένα διαφοροποιημένο χαρτοφυλάκιο Αμοιβαίων Κεφαλαίων, συμπεριλαμβανομένων και διαπραγματεύσιμων Αμοιβαίων Κεφαλαίων, που διαχειρίζονται κορυφαίοι επενδυτικοί οίκοι του εξωτερικού, τα οποία επενδύουν κυρίως σε: (α) ομόλογα εκφρασμένα σε ευρώ, (β) μέσα χρηματαγοράς και καταθέσεις, (γ) ευρωπαϊκές μετοχές.

Η διαχείριση του χαρτοφυλακίου του Υπό-Αμοιβαίου Κεφαλαίου είναι ενεργητική και βασίζεται στην αξιολόγηση μιας σειράς ποσοτικών και ποιοτικών κριτηρίων, με σκοπό την επιλογή μεμονωμένων ΟΣΕΚΑ.

Επιπλέον, το Υπο-Αμοιβαίο Κεφάλαιο εφαρμόζει συγκεκριμένα κριτήρια ESG για να καθορίσει ένα κατάλληλο φάσμα υποκείμενων ΟΣΕΚΑ με κορυφαίες αξιολογήσεις ESG και να προσανατολίσει το χαρτοφυλάκιο υπέρ όσων εμφανίζουν υψηλές επιδόσεις βιωσιμότητας. Αυτό υλοποιείται κυρίως με τη συνδυασμένη εφαρμογή αποκλεισμού (negative screening/exclusion) και θετικής επιλογής (positive screening/best-in-class).

Δείκτης Αναφοράς: 70% Bloomberg Euro Aggregate 1-3 Year Total Return Index, 10% MSCI Europe Price Return EUR Index, 20% Barclays Benchmark Overnight EUR Cash Index

Πληροφορίες

Χώρα Σύστασης	Λουξεμβούργο
Τύπος Αμοιβαίου Κεφαλαίου	ΟΣΕΚΑ (FCP)
Κατηγορία	Μικτό Fund of Funds
Ταξινόμηση SFDR	Άρθρο 8
Ημερομηνία Έναρξης	01.06.2017
Νόμισμα Βάσης	Ευρώ
Συνολικό Ενεργητικό	14,66 εκατ. €
Θεματοφύλακας	CACEIS Investor Services Bank
Αποτίμηση	Καθημερινή
Καταβολή Αξίας Εξαγοράς	Σε 4 εργάσιμες ημέρες

Κατηγορίες Μεριδίου

	EUR	EUR I
Νόμισμα	Ευρώ	Ευρώ
Ημερομηνία Έναρξης	14.07.2017	01.06.2017
Κωδικός ISIN	LU1544316919	LU1508358873
Κωδικός Bloomberg	ALPGDFE LX	ALGDFEI LX
Καθαρή Τιμή Μεριδίου	9,8150 €	9,9596 €

Προφίλ Κινδύνου

Χαμηλότερος Κίνδυνος — Υψηλότερος Κίνδυνος

1	**2**	3	4	5	6	7

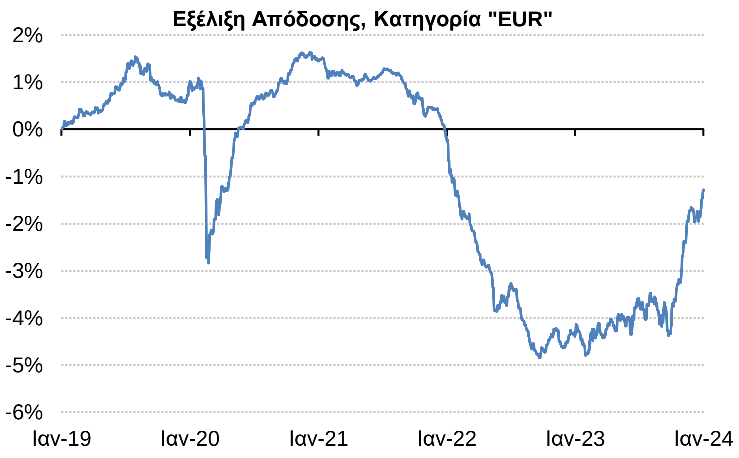
Συνοπτικός Δείκτης Κινδύνου (SRI)

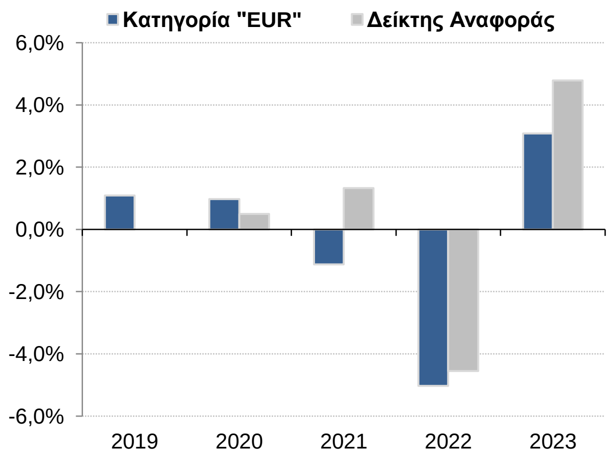
Αμοιβές / Προμήθειες

	EUR	EUR I
Αμοιβή Διαχείρισης	0,50%	0,25%
Προμήθεια Διάθεσης	1,00%	0,00%
Προμήθεια Εξαγοράς	0,00%	0,00%

Αποδόσεις (%)

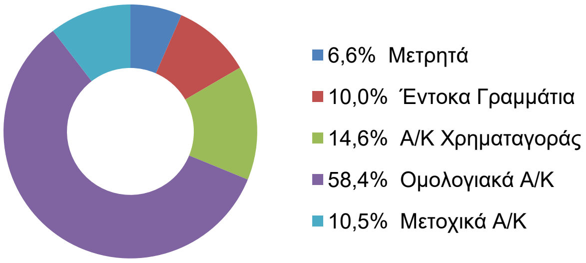
Σε Ευρώ	Σωρευτικές Αποδόσεις				Ετήσιες Αποδόσεις				
	Από Αρχή Έτους	1 Έτος	3 Έτη	5 Έτη	2019	2020	2021	2022	2023
Κατηγορία "EUR"	0,41%	3,21%	-2,69%	-1,28%	1,09%	0,97%	-1,12%	-5,03%	3,08%
Κατηγορία "EUR I"	0,44%	3,48%	-1,92%	0,02%	1,37%	1,23%	-0,88%	-4,78%	3,36%
Δείκτης Αναφοράς	0,31%	4,01%	1,88%	4,83%	-	0,50%	1,33%	-4,55%	4,79%





ΟΙ ΟΣΕΚΑ ΔΕΝ ΕΧΟΥΝ ΕΓΓΥΗΜΕΝΗ ΑΠΟΔΟΣΗ ΚΑΙ ΟΙ ΠΡΟΗΓΟΥΜΕΝΕΣ ΑΠΟΔΟΣΕΙΣ ΔΕΝ ΔΙΑΣΦΑΛΙΖΟΥΝ ΤΙΣ ΜΕΛΛΟΝΤΙΚΕΣ

Διάρθρωση Χαρτοφυλακίου



10 Μεγαλύτερες Θέσεις	
BNP Paribas InstiCash EUR 3M	14,6%
Xtrackers II Eurozone Government Bond 1-3 UCITS ETF	13,3%
JPMorgan Funds - Euro Government Short Duration Bond Fund	11,7%
BNP Paribas Funds - Sustainable Enhanced Bond 12M	9,0%
Franklin Templeton Investment Funds - Franklin European Total Return Fund	5,0%
DWS Floating Rate Notes	4,7%
BNP Paribas Funds Enhanced Bond 6M	4,7%
Vanguard EUR Eurozone Government Bond UCITS ETF	4,0%
JPMorgan Funds - EU Government Bond	3,6%
Goldman Sachs US Equity Income	3,4%

ALPHA ASSET
MANAGEMENT Α.Ε.Δ.Α.Κ.

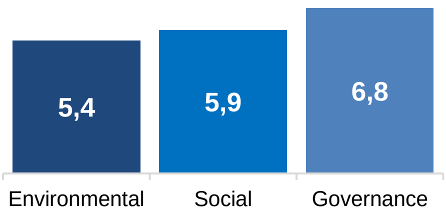
ESG Χαρακτηριστικά — Ταξινόμηση SFDR: Άρθρο 8

MSCI ESG Fund Rating

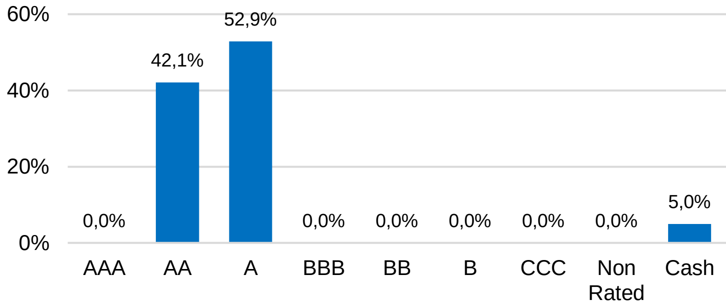
AAA	AA	**A**	BBB	BB	B	CCC

MSCI ESG Quality Score	6,9
MSCI ESG % Coverage	95,0%

ESG Scores ανά Πυλώνα



Κατανομή ανά ESG Rating



Γλωσσάρι Όρων ESG

MSCI ESG Fund Rating: Ο δείκτης αξιολόγησης MSCI ESG Rating για αμοιβαία κεφάλαια έχει σχεδιαστεί για να μετρήσει την ανθεκτικότητα των αμοιβαίων κεφαλαίων σε μακροπρόθεσμους κινδύνους και ευκαιρίες που σχετίζονται με το ESG. Η Βαθμολογία ESG υπολογίζεται ως άμεση αντιστοίχιση των ESG Quality Scores σε κατηγορίες αξιολόγησης με γράμματα.

MSCI ESG Quality Score: To MSCI ESG Quality Score (0 - 10) υπολογίζεται ως ο σταθμισμένος μέσος όρος των βαθμολογιών ESG των υποκείμενων τίτλων των αμοιβαίων κεφαλαίων.

MSCI ESG % Coverage: Ποσοστό επί των υποκείμενων τίτλων ενός αμοιβαίου κεφαλαίου για τους οποίους υπάρχουν διαθέσιμα ESG δεδομένα.

Environmental Score: To Environmental Score ενός αμοιβαίου κεφαλαίου αξιολογεί τη διαχείριση και το επίπεδο έκθεσης των υποκείμενων εκδοτών σε βασικούς περιβαλλοντικούς κινδύνους και ευκαιρίες.

Social Score: To Social Score ενός αμοιβαίου κεφαλαίου αξιολογεί τη διαχείριση και το επίπεδο έκθεσης των υποκείμενων εκδοτών σε βασικούς κοινωνικούς κινδύνους και ευκαιρίες.

Governance Score: To Governance Score ενός αμοιβαίου κεφαλαίου αξιολογεί τη διαχείριση και το επίπεδο έκθεσης των υποκείμενων εκδοτών σε βασικούς κινδύνους και ευκαιρίες που σχετίζονται με θέματα διακυβέρνησης.

ALPHA ASSET MANAGEMENT Α.Ε.Δ.Α.Κ. | Πανεπιστημίου 45 (3ος όροφος), 105 64 Αθήνα
Τηλ.: +30 210 326 6505 | E-mail: info@alphaasset.gr | Αριθμός Γ.Ε.ΜΗ. 920101000