

Στοιχεία 29/09/2023

ATHOS Recovery Ελληνικό Ομολογιακό – Κατηγορία Μεριδίων Ι

ISIN: GRF000178001

Νόμισμα Βάσης: Ευρώ



Δείκτης Κινδύνου

1	2	3	4	5	6	7
---	---	---	---	---	---	---

Χαμηλότερος κίνδυνος

Υψηλότερος κίνδυνος

Έχουμε ταξινομήσει αυτό το προϊόν στην βαθμίδα 4 από 7, η οποία είναι η «μεσαία» κατηγορία κινδύνου.

Βασικές Πληροφορίες

Σύνολο Ενεργητικού Α.Κ.	1.448.624,67€
Ενεργητικό κατηγ. μεριδίου	189.692,38€
Καθαρή τιμή μεριδίου	14,9837€
Ημερομηνία Συγκρότησης	17/05/2018
Αρ. Άδειας Επ. Κεφαλαιαγοράς	237/19.7.2017
Θεματοφύλακας	Τράπεζα Eurobank A.E.
Δείκτης Αναφοράς (Δ.Α.)	BofA M.L. Greece Government (GOGR)
Ταξινόμηση SFDR	Άρθρο 6
Νόμισμα βάσης	Ευρώ
Αμοιβή Διαχείρισης	0,75%
Προμήθεια Διάθεσης	0%
Προμήθεια Εξαγοράς	0%

Επενδυτικός Σκοπός και Επενδυτική Πολιτική

Ο επενδυτικός σκοπός του **ATHOS Recovery Ελληνικό Ομολογιακό** Αμοιβαίο Κεφάλαιο είναι η επίτευξη ικανοποιητικής απόδοσης, η οποία θα προέρχεται κυρίως από εισόδημα και δευτερευόντως από υπεραξία κεφαλαίου, με την ανάληψη του μικρότερου επενδυτικού κινδύνου.

Για την πραγματοποίηση του επενδυτικού του σκοπού, το Α.Κ. επενδύει κυρίως σε ομολογίες του Ελληνικού Δημοσίου καθώς επίσης και σε ομολογίες εταιρειών που έχουν την καταστατική τους έδρα στην Ελλάδα ή είναι Ελληνικών συμφερόντων, σε ποσοστό τουλάχιστον 65%. Το Α.Κ. δύναται να επενδύσει σε κρατικά, υπερεθνικά και εταιρικά ομόλογα εξωτερικού καθώς επίσης και σε τραπεζικές καταθέσεις και ισοδυνάμου ρευστότητας χρεωστικούς τίτλους.

Το Α.Κ. απευθύνεται σε επενδυτές με μέσο-μακροπρόθεσμο επενδυτικό ορίζοντα (άνω των 3 ετών) που κατανοούν ότι λόγω της φύσης των αγορών που επενδύει, η αξία του ενεργητικού δύναται να παρουσιάσει διακυμάνσεις.

Η διαχείριση του Α.Κ. είναι ενεργητική και κατά συνέπεια η σύνθεση του χαρτοφυλακίου καθώς και η απόδοσή του δύναται να αποκλίνουν από αυτές του Δείκτη Αναφοράς.

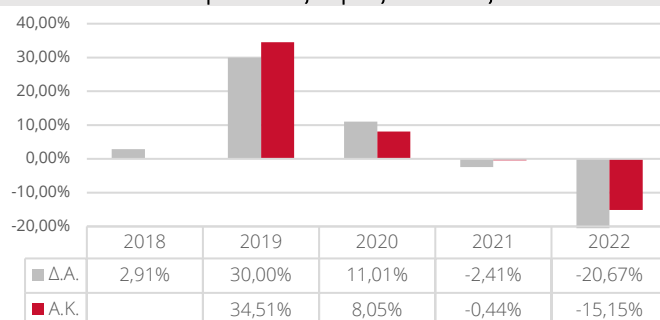
ΑΠΟΔΟΣΕΙΣ – Οι προηγούμενες αποδόσεις δεν είναι ενδεικτικές για τις μελλοντικές αποδόσεις

	YTD	Σωρευτικές				Ετησιοποιημένες		
		1 έτος	3 έτη	5 έτη	Έναρξη	3 έτη	5 έτη	Έναρξη
ATHOS Recovery	5,44%	8,54%	-7,54%	29,64%	32,56%	-2,58	5,33%	+5,39%
Δ.Α.	2,93%	6,37%	-17,77%	15,87%	18,84%	-6,31%	2,99%	3,26%
Διαφορά +/-	+2,51%	+2,18%	+7,69%	+13,77%	+13,72%	+3,73%	+2,34%	+2,12%

Εξέλιξη επένδυσης 10.000€ την ημερομηνία συγκρότησης



Παρελθούσες ετήσιες αποδόσεις

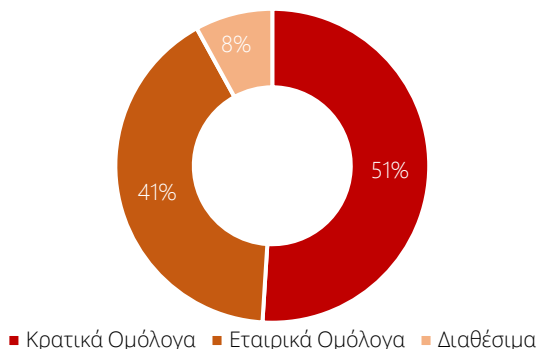


Σχόλιο Διαχειριστή

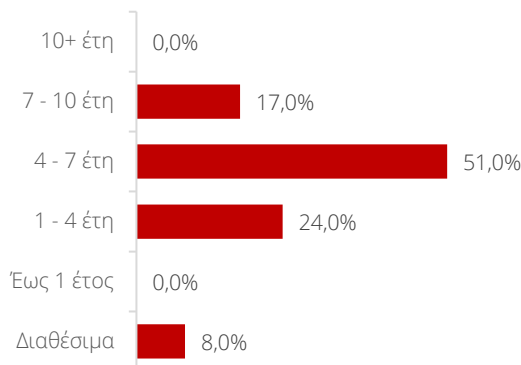
Οι διεθνείς αγορές έχουν υποστεί τελευταία μια σημαντική διόρθωση, η οποία οφείλεται κατά ένα μεγάλο ποσοστό στην σημαντική άνοδο των αποδόσεων των κρατικών ομολόγων σε παγκόσμιο επίπεδο. Ενδεικτικά το Γερμανικό 10ετές από 2,40% ανήλθε σε 2,90%, το αμερικανικό σε 4,80% από 4,20% και το Ιαπωνικό για πρώτη φορά μετά από πολλά χρόνια πλησίασε το 1%. Αντίστοιχη άνοδο των αποδόσεων είχαν και το 10ετές ΟΕΔ που ανήλθε σε 4,40% από 3,65% το τέλος Ιουνίου. Εμείς μειώσαμε την τροποποιημένη διάρκεια του χαρτοφυλακίου σε 3,63 από 5,09, με αποτέλεσμα να έχουμε παρουσιάσει συγκριτικά μια καλή εικόνα. Θεωρούμε το χαρτοφυλάκιο είναι αρκετά αμυντικό με ικανοποιητικά χαρακτηριστικά αποδόσεων / μέσης ληκτότητας και έχει τη δυνατότητα να συνεχίσει την πρόσφατη πορεία του.

Χαρτοφυλάκιο Επενδύσεων

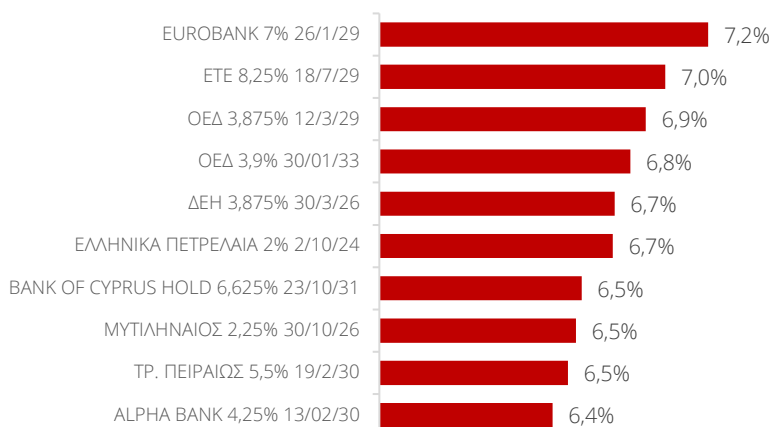
Κατανομή Χαρτοφυλακίου



Κατανομή με βάση την ωρίμανση



Μεγαλύτερες θέσεις



Χαρακτηριστικά Χαρτοφυλακίου

Χαρακτηριστικά Ομολογιακού Χαρτοφυλακίου		Συγκριτική Απόδοση Χαρτοφυλακίου*		
Τροποποιημένη διάρκεια (Modified Duration)	3,63	Δείκτες	1 έτος	3 έτη (ετησια)
Μέσο τοκομερίδιο (Average Coupon)	4,06%	Beta (β) ως προς Δ.Α.	0,54	0,61
Τρέχουσα απόδοση (Current Yield)	6,46%	R-squared A.K.	0,82	0,87
Απόδοση στη λήξη (Yield to Maturity)	6,15%	Τυπική απόκλιση (σ) Α.Κ.	4,36%	4,97%
		Τυπική Απόκλιση (σ) Δ.Α.	7,38%	7,55%
		Tracking error	3,89%	3,43%
		Sharpe ratio Α.Κ.	1,55	-1,04
		Sharpe ratio Δ.Α.	0,75	-1,11
		Information ratio Α.Κ.	0,30	0,95
Δείκτες Κινδύνου Χαρτοφυλακίου				
Value at Risk (C.I.99%)	Ημερήσιο %	Μηνιαίο %		
Αμοιβαίο Κεφάλαιο	0,53%	2,35%		
Δείκτης Αναφοράς	1,04%	4,66%		

*Τα στοιχεία συγκριτικής απόδοσης χαρτοφυλακίου Α.Κ. έχουν υπολογισθεί με βάση τις αποδόσεις της κατηγορίας μεριδίων Α του Α.Κ. Τα στοιχεία 1 έτους και 3 ετών έχουν υπολογισθεί με ημερήσια στοιχεία αποδόσεων ενώ αυτά των 3 ετών παρουσιάζονται ετησιοποιημένα με εξαίρεση τον δείκτη Beta (β).

Εταιρεία Διαχείρισης:

ATHOS ASSET MANAGEMENT Α.Ε.Δ.Α.Κ.
Αρ. Άδειας Ε.Κ. 5/781/24.4.2017
Περικλέους 2 & Λ. Κηφισίας, 154 51 Νέο Ψυχικό
Τ.+30 210 671 1500, F.+30 210 671 4800
www.athosam.com, info@athosam.com

Θεματοφύλακας:

Τράπεζα Eurobank Α.Ε.
Όθωνος 8, 105 57 Αθήνα

Αποποίηση ευθύνης:

Το παρόν έντυπο αποτελεί διαφημιστική ανακοίνωση. Πριν προχωρήσετε σε οποιαδήποτε επένδυση, συμβουλευτείτε το Ενημερωτικό Δελτίο, το Έγγραφο Βασικών Πληροφοριών (KID) καθώς και τον Κανονισμό του αμοιβαίου κεφαλαίου. Τα παραπάνω έγγραφα καθώς και οι εξαμηνιαίες – ετήσιες εκθέσεις του αμοιβαίου κεφαλαίου διατίθενται δωρεάν στα σημεία διάθεσης του αμοιβαίου κεφαλαίου καθώς και στη διεύθυνση www.athosam.com. Οι πληροφορίες που περιέχονται στο παρόν είναι επικαιροποιημένες κατά την ημερομηνία δημοσίευσής τους, αλλά υπόκεινται σε αλλαγή χωρίς σχετική προειδοποίηση. Η παρούσα ενημέρωση δεν αποτελεί παροχή επενδυτικών υπηρεσιών και δεν συνεπάγεται την προώθηση επενδυτικών προϊόντων της ATHOS ASSET MANAGEMENT ΑΕΔΑΚ και δεν πρέπει να εκληφθεί ως τέτοια από τους παραλήπτες. Η ATHOS ASSET MANAGEMENT ΑΕΔΑΚ δεν αναλαμβάνει καμία ευθύνη για οποιαδήποτε τυχόν ζημιά υποστεί οποιοσδήποτε λάβει επενδυτικές αποφάσεις στη βάση των πληροφοριών που περιέχονται στο παρόν έγγραφο.

ΟΙ ΟΣΕΚΑ ΔΕΝ ΕΧΟΥΝ ΕΓΓΥΗΜΕΝΗ ΑΠΟΔΟΣΗ ΚΑΙ ΟΙ ΠΡΟΗΓΟΥΜΕΝΕΣ ΑΠΟΔΟΣΕΙΣ ΔΕΝ ΔΙΑΣΦΑΛΙΖΟΥΝ ΤΙΣ ΜΕΛΛΟΝΤΙΚΕΣ Σελ. 2 από 2