

# C-QUADRAT ACTIVE ETF Selection CZK (t)



C-Quadrat  
Impact Asset  
Management

## Charakteristika fondu

**Model regulovaného řízení** - Fond C-QUADRAT ACTIVE ETF Selection je řízen na základě modelu alokace aktiv C-QUADRAT ACTIVE. Základem modelu je kvantitativní systém řízení s optimalizací rizika a výnosů. Na základě těchto výpočtů je sestavováno maximálně diverzifikované portfolio z investičních aktiv nejružnějších trhů. Investiční strategie se neorientuje na žádný benchmark, ale aktivním řízením rizik usiluje o eliminaci déle trvajících ztrátových období.

**Flexibilní přístup** - C-QUADRAT ACTIVE ETF Selection je flexibilní fond, jehož investičním cílem je dlouhodobý kapitálový růst při akceptování vyšší míry rizika. V rámci tohoto produktu je minimálně 51 % majetku fondu investováno do tzv. Exchange Traded Funds (ETF). C-QUADRAT ACTIVE ETF Selection může v závislosti na vývoji trhu investovat až 100 % svého majetku do akcií fondů ETF. Za nepříznivých podmínek na akciových trzích může investice do akcií opustit zcela.

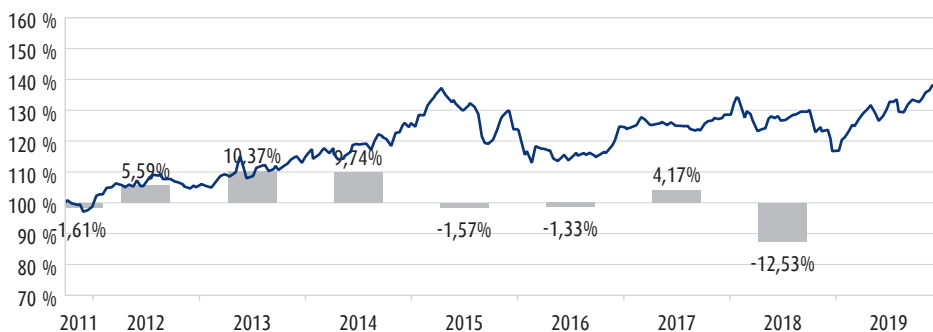
Stav k: 30.12.2019

Signatory of:



## Vývoj hodnoty od založení CZK: +4,18 % p.a.

k 30.12.2019



|     |         |       |         |       |         |            |        |
|-----|---------|-------|---------|-------|---------|------------|--------|
| YTD | 25,96 % | 1 rok | 25,96 % | 5 let | 11,45 % | 5 let p.a. | 2,19 % |
|-----|---------|-------|---------|-------|---------|------------|--------|

Minulá výkonnost není zárukou výkonnosti budoucí. Každá kapitálová investice nese určitou míru rizika. Aktuální hodnota investice může nejen růst, ale i klesat. Není zaručena návratnost původně investované částky. Vstupní a výstupní poplatky nejsou ve vývoji výkonnosti zohledněny. Pro výpočet výkonnosti je použita metodika OeKB (Rakouská kontrolní banka). V investované částce 1.000,- CZK hradí investor také vstupní poplatek ve výši max. 58,- CZK, o který se jeho vstupní investice sníží. Výnosy z investice se kromě toho snižují také o případné náklady na úschovu. Zdroj výpočtů: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH.

## Měsíční výkonnost

|      | LED    | ÚNO    | BŘE    | DUB    | KVĚ    | ČVN    | ČVC   | SRP    | ZÁŘ    | ŘÍJ    | LIS    | PRO    | rok     |
|------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|
| 2011 |        |        |        |        |        |        |       |        | -0,44% | -0,05% | -2,79% | 1,71%  | -1,61%  |
| 2012 | 3,35%  | 1,91%  | 1,23%  | -0,02% | 2,24%  | -1,61% | 2,68% | -1,05% | -0,55% | -2,05% | 0,22%  | -0,71% | 5,59%   |
| 2013 | 0,74%  | 0,87%  | 3,44%  | -0,18% | 1,88%  | -3,58% | 2,76% | -1,02% | 1,59%  | 1,83%  | 2,00%  | -0,22% | 10,37%  |
| 2014 | -1,19% | 3,22%  | -1,20% | -1,63% | 1,95%  | 1,52%  | 0,89% | 0,90%  | 0,64%  | -0,29% | 3,86%  | 0,82%  | 9,74%   |
| 2015 | 0,43%  | 4,50%  | 0,81%  | -1,18% | 1,17%  | -3,72% | 0,99% | -6,09% | -4,45% | 8,78%  | 2,60%  | -4,45% | -1,57%  |
| 2016 | -7,59% | 1,36%  | 1,31%  | -1,46% | -1,02% | -2,10% | 2,02% | 0,77%  | -0,69% | 1,38%  | 2,79%  | 2,36%  | -1,33%  |
| 2017 | 0,00%  | 2,58%  | -0,03% | -0,32% | -0,04% | -1,62% | 0,77% | -1,35% | 0,82%  | 2,55%  | 0,71%  | 0,09%  | 4,17%   |
| 2018 | 3,97%  | -2,03% | -7,30% | 2,89%  | 2,84%  | -1,69% | 1,16% | 2,19%  | 0,10%  | -7,82% | 2,19%  | -8,66% | -12,53% |
| 2019 | 7,97%  | 3,40%  | 0,69%  | 5,25%  | -5,12% | 3,15%  | 2,91% | -2,23% | 2,65%  | 0,90%  | 2,69%  | 1,64%  | 25,96%  |

## UKAZATELE (od založení)

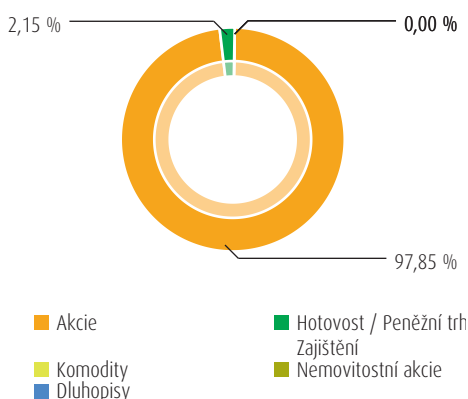
|                               |                   |
|-------------------------------|-------------------|
| Velikost fondu                | 1 294,10 mil. CZK |
| Volatilita                    | 11,07 %           |
| Nejvyšší hodnota za 12 měsíců | 1 389,24 CZK      |
| Nejnižší hodnota za 12 měsíců | 1 102,96 CZK      |
| Mod. sharpe ratio             | 0,38              |
| Max. propad                   | -22,28 %          |
| Výkonnost 2018                | -12,53 %          |
| Výkonnost 2017                | 4,17 %            |

## DATA FONDU

|                       |   |
|-----------------------|---|
| Investiční společnost | Ampega Investment GmbH  |
| Portfolio manažer     | C-QUADRAT Asset Management GmbH   |
| Depozitář fondu       | Hauck und Aufhäuser Privatbankiers KGaA   |
| Použití výnosů        | reinvestice výnosů  |
| Kód ISIN              | DE000A1C4DQ3  |
| WKN                   | A1C4DQ  |
| Měna fondu            | CZK   |
| Datum vydání          | 26.09.2011  |
| Vstupní poplatek      | až do 5,75 %  |
| Správní poplatek      | až do 1,95 % p.a. (+ 10 % odměna za výkonnost - jen při nové nejvyšší dosažené hodnotě) |
| Účetní rok            | 01.06. - 31.05.   |
| Povolení k prodeji    | AT/CZ/DE  |

## Rozložení aktiv

k 29.11.2019



Uvedené údaje o portfoliu vycházejí z posledních dostupných informačních zdrojů a proto se mohou lišit od údajů vykázaných v účetnictví fondu (právně závazný spis).

## Šance / Výhody

- Kvantitativní model alokace aktiv s regulovaným řízením
- Transparentní struktura nákladů
- Aktivní správa a aktivní řízení rizik
- Dodatečné využití fondů ETF resp. ETC se zajištěním proti měnovému riziku

## Rizika

- Riziko poklesu hodnoty podílů fondu v důsledku obecných tržních rizik (např. riziko změny kurzu nebo úrokové sazby, likviditní riziko)
- Zvláštní kurzové riziko jednotlivých tříd aktiv
- Některé části investic mohou způsobovat nadprůměrnou volatilitu hodnoty indexu
- Drobné měnové ztráty nelze vyloučit i přes zajištění (hedging) měnového rizika.

## Největší pozice

k 29.11.2019

|                                     |         |
|-------------------------------------|---------|
| Amundi JPX Nikkei 400 EUR Hedged E. | 14,49 % |
| Lyxor ETF S&P 500 EUR Hedged        | 14,16 % |
| iShares Core MSCI World ETF         | 12,67 % |
| Xtrackers MSCI World ETF            | 11,97 % |
| BNP Paribas Easy S&P 500 ETF EUR H. | 10,44 % |
| Invesco S&P 500 UCITS ETF           | 10,40 % |
| Invesco JPX-Nikkei 400 ETF EUR Hed. | 9,49 %  |
| Xtrackers MSCI Japan ETF EUR Hedge. | 5,05 %  |
| iShares S&P 500 EUR Hedged ETF      | 4,70 %  |
| Xtrackers MSCI World Financials ET. | 4,49 %  |

Tato marketingová zpráva slouží výhradně pro nezávazné informační účely a nepředstavuje nabídku ani výzvu k nákupu nebo prodeji podílových listů fondu, nelze ji pokládat za nabídku k uzavření smlouvy o službách nebo vedlejších službách spojených s cennými papíry. Tento dokument nemůže nahradit poradenství prostřednictvím Vašeho investičního poradce.

Před investováním se seznamte s prospektem fondu, roční zprávou a v případě, že je starší 8 měsíců, půlroční zprávou fondu. Klíčové informace pro investory (KID nebo KIID) v českém jazyce a zveřejněný prodejní prospekt fondu C-QUADRAT ACTIVE ETF Selection v aktuálním znění jsou zájemcům bezplatně k dispozici v německém a anglickém jazyce v sídle Ampega Investment GmbH, Charles-de-Gaulle-Platz 1, 50679 Köln a na webové stránce [www.ampega.de](http://www.ampega.de) a v sídle platebního a informačního místa v České republice UniCredit Bank Czech Republic a.s., Želetavská 1525/1, 140 92 Praha 4, Česká republika a na webové stránce [www.unicreditbank.cz](http://www.unicreditbank.cz).

Vývoj hodnoty v minulosti není spolehlivým indikátorem budoucího vývoje. Kapitálová investice do fondu je vystavena běžným ekonomickým rizikům a kolísání hodnoty, které mohou způsobit ztrátu celého vloženého kapitálu. Upozorňujeme výslovně na podrobné informace o rizicích uvedené v prospektu.

Kompletní uvedený vývoj hodnoty představuje hrubou výkonnost zahrnující veškeré související náklady na úrovni fondu a vychází z předpokladu reinvestice vyplacených zisků.

## KONTAKTNÍ ÚDAJE

INFO linka: +43 1 515 66 - 0  
e-Mail: [sales@c-quadrat.com](mailto:sales@c-quadrat.com)  
Internet: [www.cq-am.com](http://www.cq-am.com)