

alphatrust ανδρομέδα

Στοιχεία Εταιρίας:

Εταιρία Ν. 3371/2005 Άδεια Λειτουργίας:
Απόφαση Επιτρ.Κεφ.: 5/192/6.6.2000
ΑΡ.Μ.Α.Ε.: 46671/06/Β/00/75
Έδρα: Ελλάδα
Αγορά διαπραγμάτευσης: Χ.Α.
Ίδρυση Εταιρίας: 25/7/2000
Εισαγωγή στο Χ.Α: 19/12/2001

Πληροφορίες Μετοχής 30/9/2011

Εσωτερική Αξία Μετοχής: € 1,21
Χρηματιστηριακή τιμή: € 0,89
Εσ.Αξία Χαρτοφυλακίου:
€ 32.588.632,26
Premium / Discount: -26,45%
Συνολικά υπό Διαχείριση Κεφάλαια:
€ 32,6 εκ.
Κεφαλαιοποίηση: € 23,91 εκ.
Αριθμός μετοχών: 26.870.000
Ίδιες μετοχές: 36.069

Διαθεσιμότητα Αποτίμησης

Bloomberg - ANDRO GA
Reuters code - ANDR.AT
Χ.Α. - ΑΝΔΡΟ

Διαχειριστής

alphatrust Α.Ε.Π.Ε.Υ.

Τηλ.: + 302106289100

<http://www.alphatrust.eu>

Απόφ. Επιτρ. Κεφαλαιαγοράς
90ης/Θέμα2ο/19.11.96 (Φ.Ε.Κ.
1160/Β/27.12.96) ΑΡ. Μ.Α.Ε.
23491/06/Β/91/14

Τμήμα Μετόχων:

Αρμοδία τμήματος Εξυπηρέτησης
Μετόχων: Κωνσταντίνος Γκανέτσου
Τηλ.: +302106289200
mail: info@andromeda.gr
Τατοίου 21, Κηφισιά, 14561, Ελλάδα

Η **alphatrust ανδρομέδα**, Εταιρεία Επενδύσεων Χαρτοφυλακίου εδρεύει στην Ελλάδα. Στοχεύει στην επίτευξη θετικών αποδόσεων μέσω επιλεγμένων τοποθετήσεων ("Best Picks") της διαχειριστικής ομάδας της alphatrust.

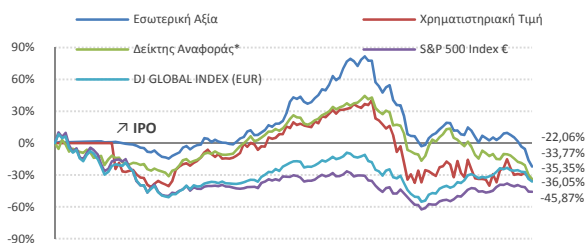
Η Εταιρεία Επενδύσεων Χαρτοφυλακίου είναι εισηγμένη στο Χρηματιστήριο Αθηνών.

Τριμηνιαία Επενδυτική Ενημέρωση Σεπτέμβριος 2011

Σχόλιο αγοράς: Η συμπερίληψη της απομείωσης των απαιτήσεων των ιδιωτών επενδυτών στην απόφαση του Ευρωπαϊκού Συμβουλίου της 21ης Ιουλίου για το δεύτερο πακέτο στήριξης της Ελλάδας αποτέλεσε ουσιαστικά το κομβικό γεγονός του τρίτου τριμήνου. Αυτό όμως δεν απέτρεψε την κατακόρυφη πτώση της εμπιστοσύνης των επενδυτών που τροφοδοτήθηκε από τη συνεχιζόμενη πολιτική και οικονομική αναταραχή στην Ευρωζώνη, τα απογοητευτικά στοιχεία για το ΑΕΠ των ΗΠΑ και τις ανησυχίες για επιβράδυνση της παγκόσμιας ανάπτυξης. Η αυξημένη αποστροφή για έκθεση σε κίνδυνο ευνόησε τα ασφαλή καταφύγια των κρατικών ομολόγων ΗΠΑ και Γερμανίας. Δεν συνέβη όμως το ίδιο και με το χρυσό που υποχώρησε σημαντικά αφού πρώτα κατέγραψε ιστορικό υψηλό το Σεπτέμβριο.

Στοιχεία αποδόσεων

Συγκριτικές αποδόσεις από ίδρυση



Συμπεριλαμβάνονται τα Μέρια
* Δείκτης Αναφοράς: 50% Γενικός Δείκτης ΧΑ & 50% Sbeul Index

Στοιχεία αποδόσεων

		Χρηματ. τιμή	Εσωτερική αξία	Δείκτης αναφοράς
3 μήνες	30/6/11 – 30/9/11	-7,95%	-19,42%	-18,54%
6 μήνες	31/12/10 – 30/9/11	-15,41%	-27,55%	-24,88%
9 μήνες	31/12/10 – 30/9/11	-13,38%	-25,93%	-21,91%
1 έτος	30/9/10 – 30/9/11	7,81%	-23,98%	-24,53%
από ίδρυση (25/07/00)		-35,35% *	-22,06%	-33,77%

* % από IPO / Σημείωση: Δείκτης Αναφοράς: 50% ΓΔΧΑ & 50% SBEUL

Γ' τρίμηνο 2011 - Στοιχεία αποδόσεων

	30/9/2011	30/6/2011	%
alphatrust ανδρομέδα			
Εσωτερική αξία	1,21	1,56	-19,42
χρημ. τιμή μετοχής	0,89	1,02	-7,95
Μετοχικοί δείκτης			
Γενικός δείκτης ΧΑ.	798,42	1.279,06	-37,58
FTSE/ASE 20	328,98	575,08	-42,79
MSCI EUROPE	78,36	94,18	-16,80
S&P 500 INDEX (€)	837,90	913,75	-8,30
NIKKEI (€)	83,83	84,44	-0,72
MSCI WORLD (€)	84,03	93,76	-10,38
DOW JONES GL (€)	159,17	181,77	-12,43

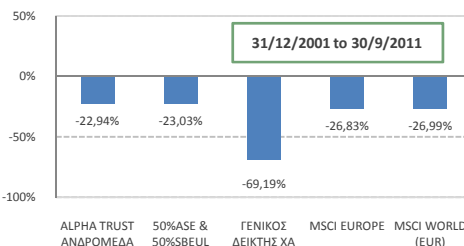
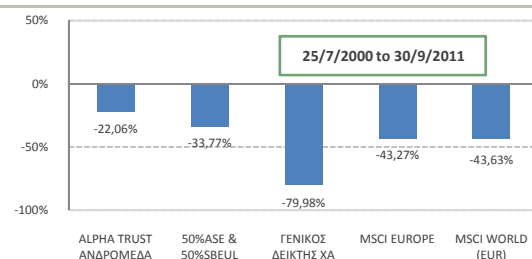
Ομολογιακοί δείκτες

SBEUL Index	699,09	667,85	4,68
SBGRL Index	82,27	110,12	-25,29
IBOXX	167,00	168,89	-1,12

Δείκτης Δ.Α.

SBWMEU1L Index	147,14	146,88	0,31
----------------	--------	--------	------

Συγκριτικά στοιχεία αποδόσεων



Μερίσματα-Επιστροφές κεφαλαίου

Ημερομηνία αποκοπής	Μέρισμα ανά μετοχή €	Ημερομηνία αποκοπής	Μέρισμα ανά μετοχή €
(09/09/11)	0,05	(14/08/08)	0,08
(21/03/11)	0,10	(12/03/08)	0,15
(10/09/10)	0,05	(10/08/07)	0,10
(22/04/10)	0,10	(09/03/07)	0,17
(29/09/09)	0,06	(10/08/06)	0,08
(26/03/09)	0,12		

Η alphatrust Α.Ε.Π.Ε.Υ. / ανδρομέδα Α.Ε.Ε.Χ. αποπεμπούνται από την Ελληνική Επιτροπή Κεφαλαιαγοράς.

Key Holdings

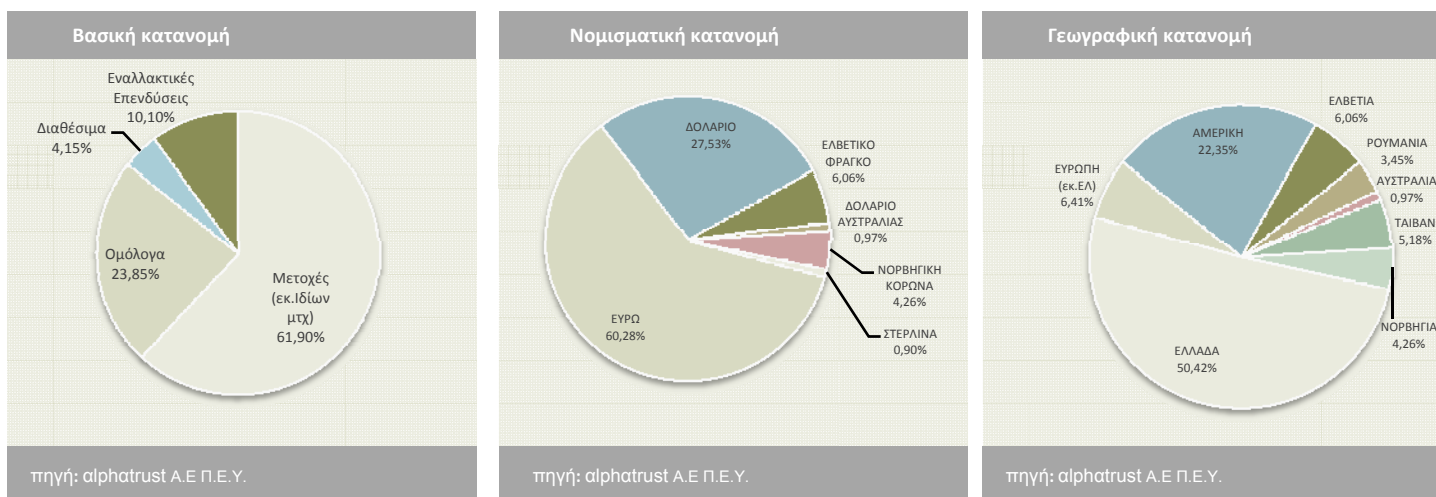
Fund data

Top Equity Holdings	% of total	Top Bond Holdings	% of total	quick facts	
S&B BIOMHXANIKΑ OPYKTA A.E.	6,28%	TITAN GLOBAL FIN 6,9% 30/07/2013	4,37%	Ίδρυση Εταιρίας	25/07/2000
APPLE INC.	4,93%	ALPHA GROUP JERSEY 4,085% 12/05/2012	3,82%	Εισαγωγή στο Χ.Α.	19/12/2001
NESTLE A.E.	4,55%	NBOG FUNDING LTD 3,03% 11/07/2013	1,59%	Εσωτερική αξία μετοχής	€ 1,21
BLACKROCK A.E.	3,86%	OTE PLC 6,0% 12/02/2015	1,57%	Discount υψηλό (2011)	-39,64%
FRIGOGLASS A.E.	3,81%	EFG HELLAS PLC 4,375% 11/02/2013	1,09%	Discount χαμηλό (2011)	-24,44%
RECONSTRUCTION CAPITAL II	3,45%	ΟΜΟΛΟΓΑ ΔΗΜΟΣΙΟΥ		αρ. μετοχών σε έκδοση	26.870.000
COCA COLA A.E.	2,92%	NORWEGIAN T-BILL 21/03/12	2,14%	Ίδιες μετοχές	36.069
CORNING A.E.	2,81%	NORWEGIAN T-BILL 21/12/11	2,11%	Εσ.Αξία Χαρτοφυλακίου	€ 32.588.632,26
FOLLI FOLLIE GROUP A.E.	2,19%	ΟΜΟΛ. ΕΛ. ΔΗΜ. 4,6% 6/02/07-20/09/40	1,81%		
INFORM Π.ΛΥΚΟΣ Α.Ε.	2,16%	EUROPEAN INV, BANK 2,5% 15/04/12	1,72%		

πηγή: alphatrust Α.Ε.Π.Ε.Υ.

πηγή: alphatrust Α.Ε.Π.Ε.Υ.

Στοιχεία σύνθεσης χαρτοφυλακίου



Risk Report Γ' τρίμηνο 2011

Μεγαλύτερη Θετική Συμβολή στο χαρτοφυλάκιο (1,2)				Μεγαλύτερη Αρνητική Συμβολή στο χαρτοφυλάκιο (1,2)			
	Συνολική απόδοση περιόδου %	Μέση συμμετοχή στο χαρτοφ. %	Συμμετοχή στην απόδοση %		Συνολική απόδοση περιόδου %	Μέση συμμετοχή στο χαρτοφ. %	Συμμετοχή στην απόδοση %
APPLE INC.	21,89	4,46	0,98	FRIGOGLASS A.B.E.E.	-44,43	3,94	-1,75
ΕΛΒΑΛ Α.Ε. ΒΙΟΜ/ΝΙΑ ΕΠΕΞΕΡΓ. ΑΛΟΥΜ.	27,78	0,89	0,25	S & B BIOMHXANIKΑ OPYKTA A.E.	-24,89	6,23	-1,55
Ο.Ε.Δ. 20/9/2040 4,6%	13,86	1,61	0,22	Paulson Advantage Plus Ltd	-29,91	4,25	-1,27
REDS A.E. ΑΝΑΠΤΥΞΗΣ ΑΚΙΝΗΤΩΝ & ΥΠΗΡ.	1,30	1,72	0,02	Paulson Enhanced Ltd	-20,82	6,07	-1,26
INDITEX SA	2,42	0,76	0,02	CORNING INC. (3)	-26,66	3,49	-0,93

Σημ.(1) για την περίοδο διακράτησης στο χαρτοφυλάκιο / Σημ.(2) λαμβάνοντας υπόψη το ποσοστό συμμετοχής στο χαρτοφυλάκιο / Σημ.(3) συμπεριλαμβάνεται μέρισμα

Στοιχεία απόδοσης κινδύνου ⁽¹⁾		Μέτρηση Value -at -Risk σε επίπεδο εμπιστοσύνης 99% (επενδυτικός ορίζοντας: 1 ημέρα) ⁽²⁾		⁽¹⁾	Γ.Δ.Χ.Α.	MSCI EUROPE	MSCI WORLD
Ιστορική Διακύμανση	12,384%	Value-at-risk	-1,256%	Volatility	34,998%	19,175%	15,181%
Διακύμανση Αρνητικών Αποδόσεων	7,424%	Expected Shortfall	-1,436%	Beta	0,291	0,309	0,364
Sharpe ratio	-2,120	Monte carlo volatility	10,350%	R square	67,545%	22,820%	19,882%
Sortino ratio	-3,536			Correlation	0,822	0,478	0,446

⁽¹⁾ Αφορούν στοιχεία 30/06/2010-30/06/2011

⁽²⁾ Αφορά σύνθεση χαρτοφυλακίου 30/06/2011

πηγή: alphatrust Α.Ε.Π.Ε.Υ.

<http://www.alphatrust.gr/andromeda.htm>

Τα στοιχεία που περιλαμβάνονται στην παρούσα ανασκόπηση αφορούν σε παρελθούσες υπηρεσίες και συναλλαγές και δεν συνιστούν δεσμευτική ή ασφαλή πρόβλεψη ως προς την αντίστοιχη απόδοση των υπηρεσιών και συναλλαγών αυτών στο μέλλον. Η παρούσα έχει σκοπό ενημερωτικό. Μέρους των πληροφοριών και των στοιχείων της παρούσας έχουν αντληθεί από αξιόπιστες πηγές, χωρίς να παρέχεται καμία εγγύηση για την ακρίβεια και την εγκυρότητά τους, οι δε εκτιμήσεις που περιέχονται δεν συνιστούν καθ' οιονδήποτε τρόπο ανάλυση, προτροπή (ή το αντίθετο) ή επενδυτική συμβουλή για πραγματοποίηση συναλλαγών. Η alphatrust Α.Ε.Π.Ε.Υ. δεν φέρει καμία ευθύνη για οποιαδήποτε επενδυτική κίνηση, που ενδεχομένως πραγματοποιηθεί, βάσει των εκτιμήσεων που δημοσιεύονται στην παρούσα, καθώς η απόδοση των επενδύσεων είναι πιθανόν να αποβεί ζημιολογός ή κερδοφόρος και συνεπώς σε καμία περίπτωση δεν μπορεί να είναι εγγυημένη. Η alphatrust Α.Ε.Π.Ε.Υ. είναι διαχειριστής της alphatrust Ανδρομέδα με άμεση συμμετοχή 0,1331% σε μετοχές της alphatrust ανδρομέδα Α.Ε.Ε.Χ.