



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 30/09/2012

Εσωτερική Αξία Μετοχής: € 19,485

Χρηματιστηριακή τιμή: € 17,700

Εσ.Αξία Χαρτοφυλακίου:

€ 5.235.577,28

Premium / Discount: -9,16%

Συνολικά υπό Διαχείριση Κεφάλαια:

€ 5,73 εκ.

Κεφαλοποίηση: € 4,76 εκ.

Αριθμός μετοχών: 268.700

Ίδιες μετοχές: 392

Διαθεσιμότητα Αποτίμησης

Bloomberg - ANDRO GA

Reuters code - ANDR.AT

Χ.Α. - ΑΝΔΡΟ

Διαχειριστής

Alpha Trust Α.Ε.Π.Ε.Υ.

Τηλ.: + 302106289100

<http://www.alphatrust.eu>

Απόφ. Επιτρ. Κεφαλαγοράς

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: Κωνσταντίνα Γκανέτσου

Τηλ.: +302106289200

mail: info@andromeda.gr

website: <http://www.andromeda.eu>

Τατοίου 21, Κηφισιά, 14561, Ελλάδα

Η Alpha Trust Α.Ε.Π.Ε.Υ. / Ανδρομέδα Α.Ε.Ε.Χ. εποπτεύονται από την Ελληνική Επιτροπή Κεφαλαγοράς.

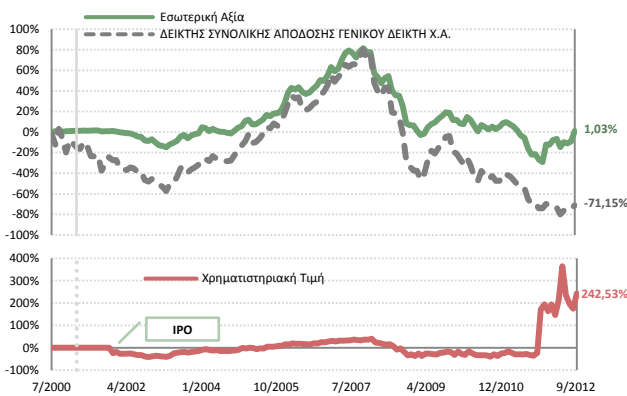
Η Alpha Trust Ανδρομέδα, Α.Ε.Ε.Χ. είναι μια εισηγμένη στο Χρηματιστήριο Αθηνών Εταιρεία Επενδύσεων Χαρτοφυλακίου που επιδιώκει να επωφεληθεί από υποεκτιμημένες αξίες στην Ελληνική αγορά μετοχών και ομολόγων. Το χαρτοφυλάκιο διαχειρίζεται η Alpha Trust Α.Ε.Π.Ε.Υ., κορυφαίος ανεξάρτητος διαχειριστής κεφαλαίων της χώρας με μεγάλη σωρευμένη εμπειρία και σημαντικές διακρίσεις.

Τριμηνιαία Επενδυτική Ενημέρωση Σεπτέμβριος 2012

Σχόλιο αγοράς: Μετά τον ορισμό κυβέρνησης τον Ιούνιο, και την συνεπακόλουθη νευρικήτητα των επενδυτών οι οποίοι είχαν βασιστεί ανηλεώς τα τελευταία τρία χρόνια, η αγορά άρχισε να ζυπνεί στο προφανές. Οι αποδόσεις που πέτυχε το χαρτοφυλάκιο στο τρίμηνο ήρθαν να προστεθούν στις καλές επιδόσεις του πρώτου εξαμήνου και μπορούμε, αν και είναι νωρίς για πανηγυρισμούς, να καμαρώνουμε για μια απόδοση 12,06% στο τρίμηνο και 42,62% από την αρχή του έτους η οποία ικανοποιεί τη Διοίκηση. Μπροστά μας έχουμε τόσους κινδύνους όσες και ευκαιρίες. Ελπίζουμε για το καλύτερο.

Στοιχεία αποδόσεων

Συγκριτικές αποδόσεις από ίδρυση

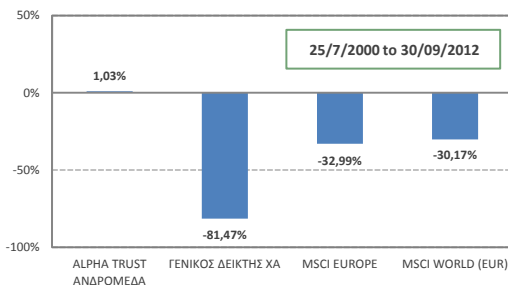


Συμπεριλαμβανονται τα Μέριασμα, Σημ.: Η εκτίμηση του ΔΕΙΚΤΗ ΣΥΝΟΛΙΚΗΣ ΑΠΟΔΟΣΗΣ ΓΕΝΙΚΟΥ ΔΕΙΚΤΗ Χ.Α., πριν την έναρξη υπολογισμού του από το ΧΑ (1/3/2001,) έχει γίνει με τη χρήση του Σταθμισμένου D.Y. του συνόλου της αγοράς, με βάση τα στοιχεία του Χρηματιστηρίου Αθηνών.

Στοιχεία αποδόσεων

		Χρηματ. τιμή	Εσωτερική αξία
3 μήνες	30/06/12 – 30/09/12	2,31%	12,06%
6 μήνες	31/03/12 – 30/09/12	39,37%	9,39%
9 μήνες	31/12/11 – 30/09/12	16,45%	42,62%
1 έτος	30/09/11 – 30/09/12	429,83%	29,62%
από ίδρυση (25/07/00)		242,54%	1,03%

Συγκριτικά στοιχεία αποδόσεων



Γ' τρίμηνο 2012 - Στοιχεία αποδόσεων

	30/09/2012	30/06/2012	%
Alpha Trust Ανδρομέδα			
Εσωτερική αξία	19,485	17,388(1)	12,06%
Χρημ. τιμή μετοχής	17,700	17,300(1)	2,31%
		(1) Adjusted	

Μετοχικοί δείκτης

Γενικός δείκτης Χ.Α.	739,12	611,16	20,94%
FTSE/ASE 20	267,89	227,14	17,94%
MSCI EUROPE	92,57	86,79	6,66%
S&P 500 INDEX (€)	1.114,21	1.081,94	2,98%
NIKKEI (€)	88,37	89,95	-1,75%
MSCI WORLD (€)	104,10	99,43	4,69%
DOW JONES GL (€)	195,92	189,40	3,44%

Ομολογιακοί δείκτες

SBEUL Index	749,05	726,74	3,07%
SBGRL Index	48,22	33,77	42,80%
IBOXX	186,66	179,03	4,26%

Δείκτης Δ.Α.

SBWMEU1L Index	147,94	147,89	0,04%
----------------	--------	--------	-------

Μέριασμα-Επιστροφές κεφαλαίου

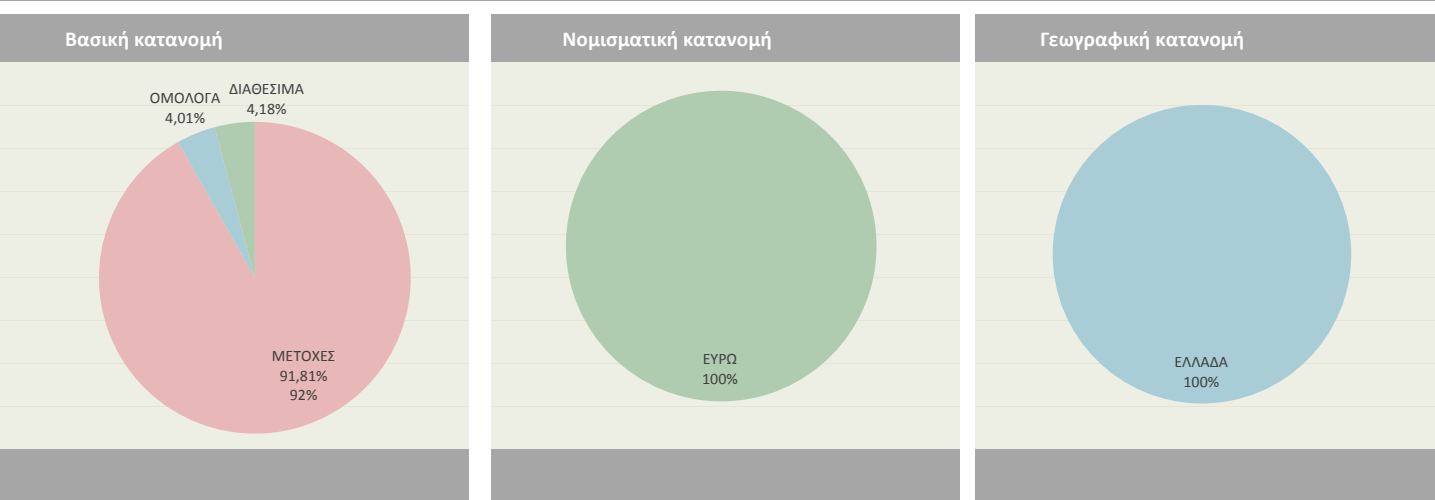
Ημερομηνία αποκοπής	Μέρισμα/Επιστροφή ανά μετοχή €	Ημερομηνία αποκοπής	Μέρισμα/Επιστροφή ανά μετοχή €
(23/11/11)	1,00	(26/03/09)	0,12
(09/09/11)	0,05	(14/08/08)	0,08
(21/03/11)	0,10	(12/03/08)	0,15
(10/09/10)	0,05	(10/08/07)	0,10
(22/04/10)	0,10	(09/03/07)	0,17
(29/09/09)	0,06	(10/08/06)	0,08

Key Holdings

Fund data

Top Equity Holdings	% of total	Top Bond Holdings	% of total	quick facts
ΠΛΑΣΤΙΚΑ ΘΡΑΚΗΣ Α.Ε.	8,85%	TITAN GLOBAL FIN 6,9% 30/07/2013	4,01%	Ίδρυση Εταιρίας 25/07/2000
INFORM Π. ΛΥΚΟΣ Α.Ε.	8,83%			Εισαγωγή στο Χ.Α. 19/12/2001
S & B ΒΙΟΜΗΧΑΝΙΚΑ ΟΡΥΚΤΑ Α.Ε.	7,56%			Εσωτερική αξία μετοχής € 19,485
FRIGOGLOSS Α.Ε.	7,00%			Discount (μέγιστο 2012) -33,04%
ΟΤΕ Α.Ε.	6,85%			Premium (ελάχιστο 2012) 50,94%
QUEST ΣΥΜΜΕΤΟΧΩΝ Α.Ε.	6,77%			αρ. μετοχών σε έκδοση 268.700
ΜΟΤΟΡ ΟΙΛ Α.Ε.	5,79%			Ίδιες μετοχές 392
ΕΛΒΕ Α.Ε.	4,92%			Εσ.Αξία Χαρτοφυλακίου € 5.235.577,28
ΠΛΑΙΣΙΟ COMPUTERS Α.Ε.	4,66%			
REDS Α.Ε.	4,29%			

Στοιχεία σύνθεσης χαρτοφυλακίου



Risk Report Γ' τρίμηνο 2012

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 %
ΠΛΑΣΤΙΚΑ ΘΡΑΚΗΣ Α.Β.Ε.Ε.	51,85%	9,79%	4,15%	ΕΛΒΕ Α.Β.Ε.Ε.	-10,71%	6,53%	-0,45%
QUEST ΣΥΜΜΕΤΟΧΩΝ (ΚΟ)	25,42%	7,58%	1,67%	ΛΙΟΛΙΚΗ Α.Ε.Ε.Χ.	-5,41%	4,31%	-0,22%
ΠΛΑΙΣΙΟ COMPUTERS Α.Ε.Β.Ε.	45,50%	4,08%	1,66%	ENVITEC S.A.	-2,56%	0,57%	-0,01%
INFORM Π. ΛΥΚΟΣ Α.Ε.	19,23%	9,14%	1,59%	ΚΑΠΝΟΒΙΟΜΗΧΑΝΙΑ ΚΑΡΕΛΙΑ Α.Ε.	-0,04%	0,54%	0,00%
JUMBO Α.Ε. (3)	47,39%	3,58%	1,56%				

Σημ.(1) για την περίοδο διακράτησης στο χαρτοφυλάκιο 1 Σημ.(2) λαμβάνοντας υπόψη το ποσοστό συμμετοχής στο χαρτοφυλάκιο 1 Σημ.(3) λαμβάνοντας υπόψη την επιστροφή κεφαλαίου

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	23,003%	Value-at-risk	-3,992%	Volatility	39,860%	18,492%	12,152%
Διακύμανση Αρνητικών Αποδόσεων	12,452%	Expected Shortfall	-4,592%	Beta	0,313	0,059	0,095
Sharpe ratio	0,875	Monte carlo volatility	33,480%	R square	29,383%	0,225%	0,250%
Sortino ratio	1,616			Correlation	0,542	0,047	0,050

⁽¹⁾ Αφορούν στοιχεία 30/09/2011-30/09/2012

⁽²⁾ Αφορά σύνθεση χαρτοφυλακίου 30/09/2012

πηγή: Alpha Trust Α.Ε.Π.Ε.Υ.

<http://www.andromeda.eu>

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 Alpha Trust 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 ζημιόγonos ή κερδοφόρος και συνεπώς σε καμία περίπτωση δεν μπορεί να είναι εγγυημένη. Η Alpha Trust Α.Ε.Π.Ε.Υ. είναι διαχειριστής της Alpha Trust Ανδρομέδα με άμεση συμμετοχή 0,1331% σε μετοχές της Alpha Trust Ανδρομέδα Α.Ε.Ε.Χ.