

# Pekao Spokojna Inwestycja - Pekao Funduszy Globalnych SFIO

Grudzień 2019

## Kluczowe informacje

Numer ISIN	PLPPTFI00394
Miejsce zarejestrowania	Polska
Aktywa netto (NAV) – mln PLN	5 006,4
Data pierwszej wyceny	2009-12-17

## Pobierane opłaty

Opłata manipulacyjna (maks.)	0,5%
Opłata za zarządzanie	0,8%

## Benchmark

Nazwa	%
WIBID1M	100

## Stopy zwrotu

Okres	Fundusz w %	Benchmark w %
1 miesiąc	0,2	0,1
3 miesiące	0,6	0,4
Od początku roku	1,6	1,5
Rok	1,6	1,5
3 lata zannualizow.	1,9	1,5
5 lat zannualizow.	1,6	1,5

## Stopy zwrotu z lat

Rok	Fundusz w %	Benchmark w %
2014	2,3	2,2
2015	1,3	1,5
2016	1,1	1,4
2017	2,3	1,5
2018	1,8	1,4

## Ostatnia aktualizacja

na 2019-12-30

Wartość jednostki uczestnictwa netto (NAV per unit) na koniec miesiąca 12,77 PLN

## Krótką charakterystyka

Subfundusz lokuje aktywa przede wszystkim w depozyty bankowe oraz instrumenty finansowe o charakterze dłużnym, np. obligacje skarbowe emitowane przez Skarb Państwa lub obligacje emitowane przez podmioty prowadzące działalność gospodarczą. Instrumenty finansowe mogą być nabywane w związku z zawarciem transakcji przy zobowiązaniu się drugiej strony do odkupu. Udział innych instrumentów finansowych niż lokaty, o których mowa powyżej, nie może przekraczać 20% wartości aktywów netto. W celu ograniczenia ryzyka walutowego wynikającego z lokat w instrumenty finansowe denominowane w walucie obcej może zawierać transakcje na instrumentach pochodnych. Duration zmodyfikowane portfela subfunduszu jest nie dłuższe niż 1 rok.

## Poniżej dane portfelowe na: 2019-06-30

### Instrumenty

Rodzaj	% NAV
Obligacje Przedsiębiorstw	34,5
Obligacje Skarbowe o Stałym Oprocentowaniu	30,0
Obligacje Skarbowe o Zmiennym Oprocentowaniu	26,1

### Podział lokat ze względu na walutę

Waluta	% NAV
PLN	86,8
USD	7,0
EUR	4,2
CZK	2,0

### Wewnętrzny rating kredytowy

Jakość / Rating	% NAV
AA	2,0
A	80,5
BBB	17,1
Brak oceny	1,3

### Największe pozycje w portfelu (TOP 5)

Nazwa	Kupon %	Termin wykupu	Rating	Duration	% NAV
WZ0524	1,8	2024-05-25	A-	0,4	11,6
WZ0126	1,8	2026-01-25	A-	0,1	6,7
PS0123	2,5	2023-01-25	A-	3,4	5,5
WZ0124	1,8	2024-01-25	A-	0,1	4,3
PS0422	2,3	2022-04-25	A-	2,8	3,3

### Analiza portfelowa

Największe 5 lokat - instr. dłużne	31,5 %
Liczba instr. dłużnych	71

### Podział lokat ze względu na kraj

Kraj	% NAV
Polska	90,0
Luksemburg	3,8
Czechy	2,0
Stany Zjednoczone	1,5
Szwecja	1,4
Węgry	1,2
Francja	0,1

Czas trwania portfela (Duration)	0,2310
Przeciętna jakość kredytowa	BBB

### Analiza ryzyka

Alfa	0,22%
Beta	-0,7789



## Wzrost wartości 10 000 PLN



## Zespół odpowiedzialny za wyniki inwestycyjne

Jacek Babiński (licencja doradcy inwestycyjnego nr 313), Michał Stawicki (licencja doradcy inwestycyjnego nr 351), Radosław Cholewiński (licencja doradcy inwestycyjnego nr 432), Łukasz Tokarski (licencja doradcy inwestycyjnego nr 310).

## Komentarz

Kryteria doboru lokat są prowadzone przy zachowaniu zasady ograniczonego ryzyka dokonywanych lokat.

W odniesieniu do instrumentów finansowych o charakterze dłużnym zarządzający subfunduszem stosuje następujące kryteria doboru lokat:

- 1) rentowność dłużnych instrumentów finansowych,
  - 2) odpowiedni poziom wiarygodności kredytowej emitentów z uwzględnieniem ich obecnej i prognozowanej sytuacji ekonomicznej z zastosowaniem zewnętrznych systemów ratingowych lub własnych wewnętrznych procedur oceny wiarygodności kredytowej, zgodnie z którymi w ocenie zarządzającego emitenci będą w stanie regulować swoje zobowiązania wynikające z tytułu wyemitowanych instrumentów dłużnych,
  - 3) prognozowany kierunek i zasięg zmian stóp procentowych,
  - 4) bezpieczeństwo zawierania i rozliczania transakcji oraz przechowywania posiadanych instrumentów finansowych,
  - 5) płynność zapewniająca realizację zobowiązań subfunduszu oraz umożliwiającą efektywną zmianę struktury portfela subfunduszu.
- Subfundusz Pekao Spokojna Inwestycja jest kierowany do inwestorów oczekujących wysokiej płynności i przewidywalnej wartości inwestycji, nie akceptujących ryzyka związanego z inwestycjami w akcje oraz akceptujących niski poziom ryzyka inwestycyjnego Subfunduszu wynikający z możliwości zainwestowania części Aktywów Subfunduszu w obligacje przedsiębiorstw oraz z wahań rynkowych stóp procentowych mających wpływ na wycenę lokat Subfunduszu. Zalecany horyzont inwestycyjny wynosi co najmniej 1 rok.

Subfundusz Pekao Spokojna Inwestycja nie jest funduszem rynku pieniężnego w rozumieniu Rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2017/1131 z dnia 14 czerwca 2017r. w sprawie funduszy rynku pieniężnego.

## Objaśnienia

### Jeśli nie stwierdzono inaczej wszystkie informacje są aktualne na 31 grudnia 2019 roku.

Prezentowane dane nie uwzględniają ekspozycji na instrumenty pochodne. Pekao Spokojna Inwestycja jest subfunduszem wchodzącym w skład funduszu Pekao Funduszy Globalnych SFIO.

Subfundusz może lokować do 100% wartości aktywów w papiery wartościowe emitowane przez dowolny z następujących podmiotów: Skarb Państwa, NBP, jednostka samorządu terytorialnego, państwo członkowskie UE, jednostka samorządu terytorialnego państwa członkowskiego UE, państwo należące do OECD lub międzynarodowa instytucja finansowa, której członkiem jest RP lub co najmniej jedno państwo członkowskie UE.

Ilekcroć w niniejszym materiale są zawarte odniesienia do portfela inwestycyjnego funduszu rozumie się przez to także odpowiednio portfel inwestycyjny subfunduszu wchodzącego w skład funduszu zarządzanego przez Pekao TFI S.A. Wykres "Wzrost wartości 10 000 PLN" prezentuje zmianę wartości j.u. dla kwoty 10 tys. PLN w okresie ostatnich 5 lat.

## Nota prawna

### Niniejszy materiał został sporządzony w celu informacyjnym.

Nie należy go traktować jako oferty funduszy inwestycyjnych lub towarzystwa funduszy inwestycyjnych w rozumieniu przepisów kodeksu cywilnego. Prezentowane w niniejszym materiale dane, stanowiące opracowanie własne Pekao TFI S.A. (PTFI), są wynikiem inwestycyjnym w konkretnym okresie historycznym i nie stanowią gwarancji osiągnięcia podobnych wyników w przyszłości. Indywidualna stopa zwrotu z inwestycji nie jest tożsama z wynikiem inwestycyjnym funduszu/subfunduszu. Wyniki przedstawione w materiale nie uwzględniają opłaty manipulacyjnej ani podatków obciążających uczestnika. Uczestnictwo w funduszu/subfunduszu wiąże się z opłatami manipulacyjnymi oraz opłatami za zarządzanie, których wysokość jest podana w prospektach informacyjnych i tabelach opłat. Wskazane opłaty obniżają stopę zwrotu z inwestycji. Zasady ustalania i pobierania opłat zawiera prospekt informacyjny. Kluczowe informacje dla Inwestorów (KII) funduszy inwestycyjnych zarządzanych przez PTFI, informacje dla Klienta AFI, jak również prospekt informacyjny tych Funduszy, zawierające szczegółowy opis czynników ryzyka związanego z inwestowaniem w te Fundusze/poszczególne subfundusze oraz szczegółowe dane na temat ich sytuacji finansowej i tabele opłat dostępne są w prowadzących dystrybucję oraz w Internecie na stronie [www.pekaotfi.pl](http://www.pekaotfi.pl)

Fundusz nie gwarantuje realizacji założonego celu inwestycyjnego ani uzyskania określonego wyniku inwestycyjnego. Indywidualna stopa zwrotu z inwestycji w dany Fundusz jest uzależniona od dnia zbycia oraz dnia odkupienia jednostek uczestnictwa przez Fundusz, a także od wysokości pobranych opłat manipulacyjnych, kategorii jednostek uczestnictwa oraz obowiązków podatkowych obciążających uczestnika, w szczególności wysokości podatku od dochodów kapitałowych. Inwestowanie w fundusze wiąże się z ryzykiem wynikającym z wahań cen na giełdzie, zmian wysokości stóp procentowych, kursów walut itp. Uczestnik Funduszu powinien mieć świadomość możliwości osiągnięcia zysku, ale również poniesienia straty. Przed podjęciem decyzji inwestycyjnych zalecane jest zapoznanie się z prospektem informacyjnym Funduszu, KII i Informacjami dla Klienta AFI.

**Pekao TFI S.A. z siedzibą w Warszawie, 02-674 Warszawa, ul. Marynarska 15,** wpisana do rejestru przedsiębiorców KRS, Sądu Rejonowego dla m.st. Warszawy, XIII Wydział Gospodarczy Krajowego Rejestru Sądowego, pod numerem KRS 0000016956, posługująca się numerem NIP 521 11 82 650. Kapitał zakładowy: 50 504 000 PLN, łączna kwota uiszczonych wkładów równa kapitałowi zakładowemu.