

Pekao Zmiennej Alokacji Rynku Amerykańskiego - Pekao Strategie Funduszowe SFIO

Grudzień 2019

Kluczowe informacje

Numer ISIN	PLPPTFI00477
Miejsce zarejestrowania	Polska
Aktywa netto (NAV) – mln PLN	43,7
Data pierwszej wyceny	2012-01-13

Pobierane opłaty

Opłata manipulacyjna (maks.)	2,5%
Opłata za zarządzanie	1,0%

Benchmark

Nazwa	%
Bez Benchmarku	Nie dotyczy

Stopy zwrotu

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

Stopy zwrotu z lat

Rok	Fundusz w %
2014	6,9
2015	0,1
2016	0,3
2017	2,6
2018	0,2

Ostatnia aktualizacja

na 2019-12-30

Wartość jednostki uczestnictwa netto (NAV per unit) na koniec miesiąca 13,50 PLN

Krótką charakterystyka

Subfundusz stosujący strategię ochrony kapitału. Dąży do ochrony wartości jednostki uczestnictwa na koniec każdego 3,5-letniego okresu rozliczeniowego, tak aby jej wartość nie spadła poniżej 100% wartości z początku tego okresu. W tym celu zmienia proporcje pomiędzy częścią portfela inwestycyjnego o charakterze udziałowym a częścią portfela inwestycyjnego o charakterze dłużnym, w zależności od sytuacji na rynku akcji, w szczególności amerykańskich. Do 50% aktywów może być inwestowane w tytuły uczestnictwa funduszy zagranicznych o charakterze udziałowym, dających ekspozycję na akcje spółek oraz rynki akcyjne w USA lub Ameryce Północnej. Udział instrumentów finansowych o charakterze dłużnym, głównie obligacji skarbowych, instrumentów rynku pieniężnego oraz depozytów bankowych, może stanowić do 100% aktywów subfunduszu. W celu ograniczenia ryzyka walutowego zawiera transakcje na instrumentach pochodnych.

Poniżej dane portfelowe na: 2019-06-30

Analiza portfelowa

Największe 10 lokat - instr. akcyjne	4,6 %
Największe 5 lokat - instr. dłużne	86,9 %
Liczba instr. akcyjnych	1
Liczba instr. dłużnych	8

Podział lokat ze względu na kraj

Kraj	% NAV
Polska	95,4
Luksemburg	4,6

Analiza ryzyka

Alfa	Nie dotyczy
Beta	Nie dotyczy

Poniżej dane portfelowe na: 2019-06-30

CZĘŚĆ AKCYJNA

PORTFELA SUBFUNDUSZU

Podział sektorowy lokat

Sektor	% NAV
Zagraniczne fundusze inwestycyjne	4,6

Największe pozycje w portfelu (TOP 10)

Nazwa	Sektor	Kraj	% NAV
Xtrackers - MSCI USA Swap UCITS ETF	Zagraniczny fundusz inwestycyjny	LU	4,6

CZĘŚĆ DŁUŻNA

PORTFELA SUBFUNDUSZU

Wewnętrzny rating kredytowy

Jakość / Rating	% NAV
A	89,4

Podział lokat ze względu na walutę

Waluta	% NAV
PLN	100,0

Największe pozycje w portfelu (TOP 5)

Nazwa	Kupon %	Termin wykupu	Rating	Duration	% NAV
PS0123	2,5	2023-01-25	A-	3,4	22,7
PS0424	2,5	2024-04-25	A-	4,6	22,5
DS1023	4,0	2023-10-25	A-	4,0	18,3
PS0422	2,3	2022-04-25	A-	2,8	17,9
PS0421	2,0	2021-04-25	A-	1,8	5,5

Instrumenty

Rodzaj	% NAV
Obligacje skarbowe o stałym oprocentowaniu	89,4
Środki pieniężne	5,9
Depozyty	0,1

Czas trwania portfela (Duration)	3,3216
Przeciętna jakość kredytowa	A-

Wzrost wartości 10 000 PLN

