

# Pekao Strategii Globalnej - dynamiczny - Pekao Strategie Funduszowe SFIO

Grudzień 2020

## Kluczowe informacje

Numer ISIN	PLPPTFI00600
Miejsce zarejestrowania	Polska
Aktywa netto (NAV) – mln PLN	23,0
Data pierwszej wyceny	2017-02-08

## Pobierane opłaty

Opłata manipulacyjna (maks.)	4,5%
Opłata za zarządzanie	2,5%

## Benchmark

Nazwa	%
MSCI Emerging Markets NR (USD)	10
MSCI World in Local Currency	80
WIBID	10

## Stopy zwrotu

Okres	Fundusz w %	Benchmark w %
1 miesiąc	3,2	3,4
3 miesiące	11,4	11,6
Od początku roku	9,3	13,0
Rok	9,3	13,0
3 lata zannualizow.	5,5	9,2

## Stopy zwrotu z lat

Rok	Fundusz w %	Benchmark w %
2018	-12,1	-7,4
2019	22,3	24,3

## Ostatnia aktualizacja

na 2020-12-30

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

## Krótką charakterystyka

Całość aktywów subfunduszu może być inwestowana w tytuły uczestnictwa funduszy zagranicznych o charakterze udziałowym, inwestujących na globalnych rynkach akcji. Dla zapewnienia odpowiedniej płynności subfundusz może lokować aktywa m.in. w obligacje skarbowe, instrumenty rynku pieniężnego oraz depozyty bankowe. W celu ograniczenia ryzyka walutowego subfundusz transakcje na instrumentach pochodnych.

## Poniżej dane portfelowe na: 2020-06-30

### Ekspozycja na sektory

Zbiorcza analiza funduszy wchodzących w skład portfela

Sektor	% NAV
Usługi finansowe	7,3
Technologie	5,0
Artykuły przemysłowe	4,5
Sektor konsumpcyjny procykliczny	4,5
Ochrona zdrowia	4,5
Sektor konsumpcyjny defensywny	4,2
Usługi komunikacyjne	3,8
Materiały podstawowe	3,1
Energetyka	1,7
Usługi użyteczności publicznej	1,2
Nieruchomości	0,7
Fundusze typu ETF	0,3

### Ekspozycja na kraje

Zbiorcza analiza funduszy wchodzących w skład portfela

Kraj	% NAV
Stany Zjednoczone	53,7
Japonia	6,4
Wielka Brytania	4,5
Chiny	4,4
Szwajcaria	2,9
Francja	2,9
Kanada	2,7
Niemcy	2,5
Australia	1,9
Tajwan	1,4
Holandia	1,2
Korea Południowa	1,2

### Skład portfela

Nazwa	% NAV
LYXOR MSCI USA UCITS ETF USD	17,0
XTRACKERS - MSCI USA SWAP UCITS ETF 1C USD	17,0
LYXOR MSCI USA UCITS ETF	9,7
AMUNDI IS SICAV - MSCI USA UCITS ETF - UCITS ETF - USD	9,7
BLACKROCK ISF - ISHARES EUROPE EX UK INDEX FUND I EUR	8,4
INVESCO FUNDS - JAPANESE EQUITY ADVANTAGE FUND - Z JPY	6,4
ISHARES PLC - MSCI EURO. EX-UK UCITS ETF - EUR	5,0
UBS ETF - MSCI UNITED KINGDOM UCITS ETF - (GBP)	4,4
UBS ETF - MSCI CANADA UCITS ETF - CAD A	2,7
JPM EMERGING MARKETS OPPORTUNITIES I USD	2,5

### Największe pozycje (TOP 10)

Zbiorcza analiza funduszy wchodzących w skład portfela

Nazwa	Sektor	Kraj	% NAV
Tencent Holdings	Usługi komunikacyjne	CN	0,9
Alibaba Group Holding	Sektor konsumpcyjny procykliczny	CN	0,9
Nestle SA	Sektor konsumpcyjny defensywny	CH	0,7
Taiwan Semiconductor Manufacturing	Technologie	TW	0,6
Roche Holding AG	Ochrona zdrowia	CH	0,5
AIA Group	Usługi finansowe	HK	0,5
Samsung Electronics	Technologie	KR	0,4
Novartis AG	Ochrona zdrowia	CH	0,4
Trend Micro	Technologie	JP	0,4
Square Enix Holdings	Usługi komunikacyjne	JP	0,3

### Analiza portfelowa

Zbiorcza analiza funduszy wchodzących w skład portfela

Udział instr. akcyjnych	41,1 %
Udział pozostałych instr., w tym dłużnych	58,9 %
Liczba instr. akcyjnych	1 232
Liczba instr. dłużnych	2

### Analiza ryzyka

Alfa	- 0,28%
Beta	0,968

**Wzrost wartości 10 000 PLN**



**Zespół odpowiedzialny za wyniki inwestycyjne**

Jacek Babiński (licencja doradcy inwestycyjnego nr 313), Karol Ciuk (licencja doradcy inwestycyjnego nr 343).

**Komentarz**

Proporcja między lokatami subfunduszu w tytuły uczestnictwa funduszy zagranicznych oraz w jednostki uczestnictwa funduszy inwestycyjnych, może ulegać zmianie w zależności od oceny potencjału wzrostowego i dochodowości poszczególnych kategorii lokat.

W odniesieniu do tytułów uczestnictwa poszczególnych funduszy zagranicznych, które są przedmiotem lokat subfunduszu, zarządzający stosuje następujące kryteria doboru lokat:

- adekwatność polityki inwestycyjnej funduszu zagranicznego do polityki inwestycyjnej subfunduszu,
  - osiągane i przewidywane stopy zwrotu,
  - poziom ryzyka inwestycyjnego,
  - poziom kosztów obciążających uczestników danego funduszu zagranicznego,
  - wartość aktywów oraz ocenę ryzyka ograniczeń w odkupieniu tytułów uczestnictwa (możliwość odkupienia tytułów uczestnictwa i wyjście z inwestycji),
  - bezpieczeństwo zawierania i rozliczania transakcji oraz przechowywania i wykonywania praw z posiadanych tytułów uczestnictwa.
- W odniesieniu do instrumentów finansowych o charakterze dłużnym zarządzający stosuje następujące kryteria doboru lokat:
- rentowność dłużnych instrumentów finansowych,
  - 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,
  - prognozowany kierunek i zasięg zmian stóp procentowych,
  - bezpieczeństwo zawierania i rozliczania transakcji oraz przechowywania posiadanych instrumentów finansowych,
  - płynność zapewniająca realizację zobowiązań subfunduszu oraz umożliwiającą efektywną zmianę struktury portfela.

**Objaśnienia**

**Jeśli nie stwierdzono inaczej wszystkie informacje są aktualne na 31 grudnia 2020 roku.**

Prezentowane dane nie uwzględniają ekspozycji na instrumenty pochodne. Pekao Strategii Globalnej-dynamiczny jest subfunduszem wchodzącym w skład funduszu Pekao Strategie Funduszowe SFIO. Z uwagi na fakt, że znaczna część aktywów subfunduszu może być lokowana w tytuły uczestnictwa funduszy zagranicznych, inwestujących w instrumenty finansowe o charakterze udziałowym, wartość jednostki uczestnictwa subfunduszu może charakteryzować się dużą zmiennością.

Informacje o indeksach:  
2020 **MSCI**. Wszelkie prawa zastrzeżone.  
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 prospekty informacyjne tych Funduszy, zawierające szczegółowy opis czynników ryzyka związanego z inwestowaniem w te Fundusze/poszczególne subfundusze, zwięzły opis praw uczestników oraz szczegółowe dane na temat ich sytuacji finansowej i tabelę opłat dostępne są w j. polskim u 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 oraz KII.

**Pekao TFI S.A. z siedzibą w Warszawie 02-674, ul. Marynarska 15**, wpisana do rejestru przedsiębiorców KRS, Sądu Rejonowego dla m.st. Warszawy w Warszawie, 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.