

Pekao Obligacji Europejskich Plus - Pekao Walutowy FIO

Wrzesień 2021

Kluczowe informacje

Numer ISIN	PLPPTFI00139
Miejsce zarejestrowania	Polska
Aktywa netto (NAV) – mln PLN	189,7
Data pierwszej wyceny	2003-06-06

Pobierane opłaty

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

Benchmark

Nazwa	%
Nie dotyczy	

Stopy zwrotu

Okres	Fundusz w %	Benchmark w %
1 miesiąc	1,4	
3 miesiące	2,2	
Od początku roku	1,8	
Rok	4,6	
3 lata zannualizow.	3,8	
5 lat zannualizow.	1,0	

Stopy zwrotu z lat

Rok	Fundusz w %	Benchmark w %
2016	5,9	
2017	-7,5	
2018	-2,0	
2019	3,0	
2020	7,9	

Ostatnia aktualizacja

na 2021-09-30

Wartość jednostki uczestnictwa netto (NAV per unit) na koniec miesiąca 48,50 PLN

Krótką charakterystyka

Subfundusz o charakterze obligacyjnym. Lokuje min. 70% wartości aktywów netto w tytuły uczestnictwa funduszy zagranicznych o charakterze dłużnym oraz w instrumenty finansowe o charakterze dłużnym. Min. 70% wartości aktywów netto jest denominowane w euro. Subfundusz może inwestować w lokaty denominowane w dowolnych walutach. W przypadku gdy część lokat jest denominowana w innej walucie niż euro, w celu ograniczenia ryzyka walutowego związanego ze zmianą kursów innych walut w relacji do euro, subfundusz zawiera transakcje na instrumentach pochodnych. Aktywa subfunduszu nie będą lokowane w instrumenty finansowe o charakterze udziałowym. W celu zapewnienia odpowiedniej płynności fundusz może lokować aktywa subfunduszu w obligacje skarbowe, instrumenty rynku pieniężnego oraz depozyty bankowe.

Poniżej dane portfelowe na: 2021-06-30

Ekspozycja na sektory

Zbiorcza analiza funduszy wchodzących w skład portfela

Sektor	% NAV
Obligacje korporacyjne	83,2
Obligacje zamienne	5,9
Rządowe papiery wartościowe	4,1
Instrumenty dłużne agencji rządowych	1,8
Obligacje zabezpieczone	0,2
Papiery typu ABS	0,2
Opcje kupna	0,1
Kontrakty futures na skarbowe papiery wartościowe	-1,6

Ekspozycja na kraje

Zbiorcza analiza funduszy wchodzących w skład portfela

Kraj	% NAV
Niemcy	17,9
Stany Zjednoczone	16,7
Wielka Brytania	12,3
Francja	12,0
Włochy	6,7
Holandia	4,1
Hiszpania	3,9
Szwajcaria	3,8
Szwecja	2,5
Australia	2,1
Belgia	1,8
Chiny	1,6

Analiza portfelowa

Zbiorcza analiza funduszy wchodzących w skład portfela

Udział instr. akcyjnych	0,5 %
Udział pozostałych instr., w tym dłużnych	99,5 %
Liczba instr. akcyjnych	14
Liczba instr. dłużnych	3 341

Skład portfela

Nazwa	% NAV
SCHRODER ISF EURO CORPORATE BOND - UNIT C	18,0
BLACKROCK BGF - EURO CORPORATE BOND - I2	18,0
MORGAN STANLEY IF - EURO CORPORATE BOND Z - EUR	18,0
BLUEBAY FUNDS - BLUEBAY INVESTMENT GRADE BOND FUND - I - EUR	17,9
SCHRODER ISF - EURO CREDIT CONVICTION - C	17,9
JANUS HERDENSON HF - EURO CORPORATE BOND FUND I2 EURO	5,0
BNP PARIBAS INSTICASH EUR 1D SHORT TERM VNAV	2,9
G FUND - ALPHA FIXED INCOME - I EUR	1,9

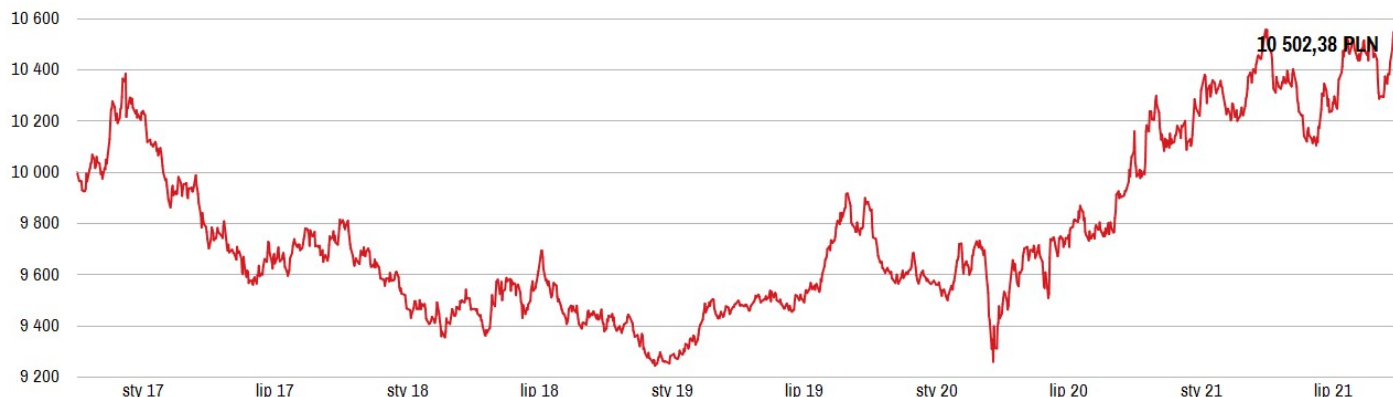
Największe pozycje (TOP 5)

Zbiorcza analiza funduszy wchodzących w skład portfela

Nazwa	Sektor	Kraj	% NAV
Germany (Federal Republic Of)	Rządowe papiery wartościowe	DE	1,3
Euro Bobl Future Sept 21	Kontrakty futures na skarbowe papiery wartościowe	DE	0,9
Germany (Federal Republic Of) 0.5%	Rządowe papiery wartościowe	DE	0,8
Germany (Federal Republic Of) 0%	Rządowe papiery wartościowe	DE	0,8
Euro Bund Future Sept 21	Kontrakty futures na skarbowe papiery wartościowe	DE	0,7



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

W odniesieniu do tytułów uczestnictwa poszczególnych funduszy zagranicznych zarządzający stosuje następujące kryteria doboru lokat:

- adekwatność polityki inwestycyjnej funduszu zagranicznego do polityki inwestycyjnej,
- osiągane i przewidywane stopy zwrotu,
- poziom ryzyka inwestycyjnego,
- poziom kosztów obciążających uczestników danego funduszu,
- 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 30 września 2021 roku.

Prezentowane dane nie uwzględniają ekspozycji na instrumenty pochodne. Pekao Obligacji Europejskich Plus jest subfunduszem wchodzącym w skład funduszu Pekao Walutowy FIO.

Subfundusz w celu zapewnienia odpowiedniej płynności może do 33% wartości aktywów lokować w instrumenty finansowe o charakterze dłużnym emitowane, poręczane lub gwarantowane przez Skarb Państwa RP oraz przez inne państwa członkowskie UE, a także w dopuszczone do obrotu zorganizowanego lub będące w ofercie publicznej na terytorium RP lub innego państwa członkowskiego UE instrumenty finansowe o charakterze dłużnym a także w depozyty bankowe.

Informacje o indeksach:
2021 **Intercontinental Exchange („ICE“)**, wykorzystane za zgodą. ICE zezwala na wykorzystanie indeksów ICE i związanych z nimi danych "w stanie w jakim są", nie udziela jakichkolwiek gwarancji w odniesieniu do tych danych, nie gwarantuje odpowiedniości, jakości, dokładności, aktualności, i/lub kompletności indeksów ICE lub wszelkich zawartych, związanych lub uzyskanych z nich danych, nie ponosi odpowiedzialności w związku z użytkowaniem wyżej wymienionych danych oraz nie sponsoruje, nie popiera ani nie rekomenduje Pekao TFI S.A., w tym żadnych jego produktów lub usług.

Inwestycja w subfundusz dokonana w PLN niesie dodatkowe ryzyko walutowe, co może mieć wpływ na stopę zwrotu z jednostki uczestnictwa subfunduszu obliczanej w PLN.

Wykres wzrostu wartości 10 000 PLN obejmuje okres ostatnich 5 lat.

***Porównanie do benchmarku ma miejsce jedynie w odniesieniu do jednostki uczestnictwa wyrażonej w walucie tj. w EUR**

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, jak również prospekty informacyjne tych Funduszy, zawierające szczegółowy opis czynników ryzyka związanego z inwestowaniem w te Fundusze/poszczególne subfundusze, zwięzły opis praw uczestnictwa oraz szczegółowe dane na temat ich sytuacji finansowej i tabelę opłat dostępne są w jęz. polskim u prowadzących dystrybucję oraz w Internecie na stronie 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 000016956, posługująca się numerem NIP 521 11 82 650. Kapitał zakładowy: 50 504 000 PLN, łączna kwota uiszczonych wkładów równa kapitałowi zakładowemu.