

Pekao Obligacji Dolarowych Plus - Pekao Walutowy FIO

Wrzesień 2021

Kluczowe informacje

Numer ISIN	PLPPTFI00113
Miejsce zarejestrowania	Polska
Aktywa netto (NAV) – mln PLN	1 204,5
Data pierwszej wyceny	2002-05-02

Pobierane opłaty

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

Benchmark

Nazwa	%
Bez Benchmarku	Nie dotyczy

Stopy zwrotu

Okres	Fundusz w %
1 miesiąc	-1,1
3 miesiące	-0,5
Od początku roku	0,6
Rok	5,3
3 lata zannualizow.	3,7
5 lat zannualizow.	2,2

Stopy zwrotu z lat

Rok	Fundusz w %
2016	5,0
2017	4,2
2018	-4,6
2019	8,8
2020	4,4

Ostatnia aktualizacja

na 2021-09-30

Wartość jednostki uczestnictwa netto (NAV per unit) na koniec miesiąca 22,04 USD

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 USD. Subfundusz może inwestować w lokaty denominowane w dowolnych walutach. W przypadku gdy część lokat subfunduszu jest denominowana w innej walucie niż USD, w celu ograniczenia ryzyka walutowego związanego ze zmianą kursów innych walut w relacji do USD, 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	74,2
Rządowe papiery wartościowe	13,0
Instrumenty dłużne agencji rządowych	3,5
Obligacje zamienne	2,5
Papiery komercyjne typu MBS	0,4
Papiery typu ABS	0,2
Obligacje przychodowe	0,1
Działalność ponadnarodowa	0,1
Kontrakty futures na skarbowe papiery wartościowe	-2,6

Ekspozycja na kraje

Zbiorcza analiza funduszy wchodzących w skład portfela

Kraj	% NAV
Stany Zjednoczone	51,8
Chiny	3,6
Wielka Brytania	3,4
Meksyk	2,5
Francja	2,2
Kanada	2,2
Brazylia	2,2
Luksemburg	1,8
Ukraina	1,5
Turcja	1,4
Holandia	1,2
Dominikana	1,0

Analiza portfelowa

Zbiorcza analiza funduszy wchodzących w skład portfela

Udział instr. akcyjnych	2,5 %
Udział pozostałych instr., w tym dłużnych	97,5 %
Liczba instr. akcyjnych	58
Liczba instr. dłużnych	2 422

Skład portfela

Nazwa	% NAV
MORGAN STANLEY IF - US DOLLAR HIGH YIELD BOND - Z USD	18,1
JANUS HENDERSON HF - GLOBAL HIGH YIELD BOND - I2 USD	18,0
AMUNDI FUNDS EMERGING MARKETS BOND - I2 USD	18,0
PGIM FUNDS PLC - PGIM US CORPORATE BOND FUND USD UNIT I	15,4
MS INVESTMENT FUNDS - US DOLLAR CORPORATE BOND FUND USD UNIT Z	12,3
BNP PARIBAS FUNDS - EMERGING BOND I USD	9,5
FIDELITY FUNDS - US HIGH YIELD FUND I USD	6,6
FIDELITY INSTITUTIONAL LIQUIDITY FUND - THE UNITED STATES \$ FUND	2,3

Największe pozycje (TOP 5)

Zbiorcza analiza funduszy wchodzących w skład portfela

Nazwa	Sektor	Kraj	% NAV
Us Long Bond Sep 21	Kontrakty futures na skarbowe papiery wartościowe	N/A	1,3
Us 2yr Note Sep 21	Kontrakty futures na skarbowe papiery wartościowe	N/A	1,0
JP Morgan Chase FRN	Obligacje korporacyjne	US	0,5
Us 5yr Note Sep 21	Kontrakty futures na skarbowe papiery wartościowe	N/A	0,5
Ukraine (Republic of) 7.75%	Rządowe papiery wartościowe	UA	0,5



Wzrost wartości 10 000 USD



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 Dolarowych Plus jest subfunduszem wchodzącym w skład funduszu Pekao Walutowy FIO.

Wykres wzrostu wartości 10 000 USD obejmuje okres 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, 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 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.