

Pekao Akcji Europejskich - Pekao Walutowy FIO

Wrzesień 2021

Kluczowe informacje

| | |
|------------------------------|--------------|
| Numer ISIN | PLPPTFI00147 |
| Miejsce zarejestrowania | Polska |
| Aktywa netto (NAV) – mln PLN | 270,7 |
| Data pierwszej wyceny | 2004-04-29 |

Pobierane opłaty

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

Benchmark

| Nazwa | % |
|-------------|---|
| Nie dotyczy | |

Stopy zwrotu

| Okres | Fundusz w % | Benchmark w % |
|---------------------|-------------|---------------|
| 1 miesiąc | -1,5 | |
| 3 miesiące | 3,1 | |
| Od początku roku | 15,8 | |
| Rok | 26,9 | |
| 3 lata zannualizow. | 7,2 | |
| 5 lat zannualizow. | 5,9 | |

Stopy zwrotu z lat

| Rok | Fundusz w % | Benchmark w % |
|------|-------------|---------------|
| 2016 | 1,4 | |
| 2017 | 0,4 | |
| 2018 | -14,9 | |
| 2019 | 21,4 | |
| 2020 | 2,6 | |

Ostatnia aktualizacja

na 2021-09-30

Wartość jednostki uczestnictwa netto (NAV per unit) na koniec miesiąca 61,76 PLN

Krótką charakterystyka

Subfundusz o charakterze akcyjnym. Lokuje minimum 70% wartości aktywów netto w tytuły uczestnictwa funduszy zagranicznych o charakterze udziałowym oraz instrumenty finansowe o charakterze udziałowym, dające ekspozycję na akcje spółek oraz rynki akcyjne w Europie. Minimum 70% wartości aktywów netto subfunduszu 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. Dla zapewnienia odpowiedniej płynności może lokować aktywa 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 |
|----------------------------------|-------|
| Artykuły przemysłowe | 14,3 |
| Ochrona zdrowia | 13,5 |
| Usługi finansowe | 12,8 |
| Sektor konsumpcyjny defensywny | 12,1 |
| Sektor konsumpcyjny procykliczny | 12,0 |
| Technologie | 8,3 |
| Materiały podstawowe | 7,9 |
| Usługi komunikacyjne | 5,8 |
| Energetyka | 2,7 |
| Usługi użyteczności publicznej | 2,6 |
| Nieruchomości | 1,5 |
| Fundusze typu zamkniętego | 0,3 |

Ekspozycja na kraje

Zbiorcza analiza funduszy wchodzących w skład portfela

| Kraj | % NAV |
|-------------------|-------|
| Wielka Brytania | 20,7 |
| Francja | 16,7 |
| Niemcy | 13,8 |
| Szwajcaria | 12,6 |
| Holandia | 8,3 |
| Szwecja | 4,7 |
| Dania | 4,0 |
| Włochy | 3,5 |
| Stany Zjednoczone | 3,2 |
| Hiszpania | 2,9 |
| Finlandia | 1,6 |
| Belgia | 1,6 |

Skład portfela

| Nazwa | % NAV |
|---|-------|
| JPMORGAN FUNDS - EUROPE SELECT EQUITY - I EUR | 18,2 |
| MFS MERIDIAN FUNDS - EUROPEAN RESEARCH FUND I1 EUR | 18,0 |
| ISHARES III PLC - MSCI EUROPE UCITS ETF EUR | 18,0 |
| AMUNDI IS SICAV - INDEX MSCI EUROPE UCITS ETF DR - EUR | 18,0 |
| MFS MERIDIAN FUNDS - EUROPEAN CORE EQUITY FUND - I1 EUR | 11,2 |
| G FUND AVENIR EUROPE I EUR | 6,3 |
| DPAM INVEST B EQUITIES EUROPE SMALL CAPS UNIT F EUR | 6,0 |
| BNP PARIBAS INSTICASH EUR 1D SHORT TERM VNAV | 4,4 |

Największe pozycje (TOP 10)

Zbiorcza analiza funduszy wchodzących w skład portfela

| Nazwa | Sektor | Kraj | % NAV |
|-------------------------------------|----------------------------------|------|-------|
| Nestle SA | Sektor konsumpcyjny defensywny | CH | 2,7 |
| Roche Holding AG | Ochrona zdrowia | CH | 2,6 |
| LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | Sektor konsumpcyjny procykliczny | FR | 2,5 |
| Novo Nordisk | Ochrona zdrowia | DK | 1,8 |
| ASML Holding NV | Technologie | NL | 1,7 |
| Schneider Electric SE | Artykuły przemysłowe | FR | 1,6 |
| Diageo PLC | Sektor konsumpcyjny defensywny | GB | 1,2 |
| Novartis AG | Ochrona zdrowia | CH | 1,1 |
| Akzo Nobel NV | Materiały podstawowe | NL | 0,9 |
| Adidas AG | Sektor konsumpcyjny procykliczny | DE | 0,9 |

Analiza portfelowa

Zbiorcza analiza funduszy wchodzących w skład portfela

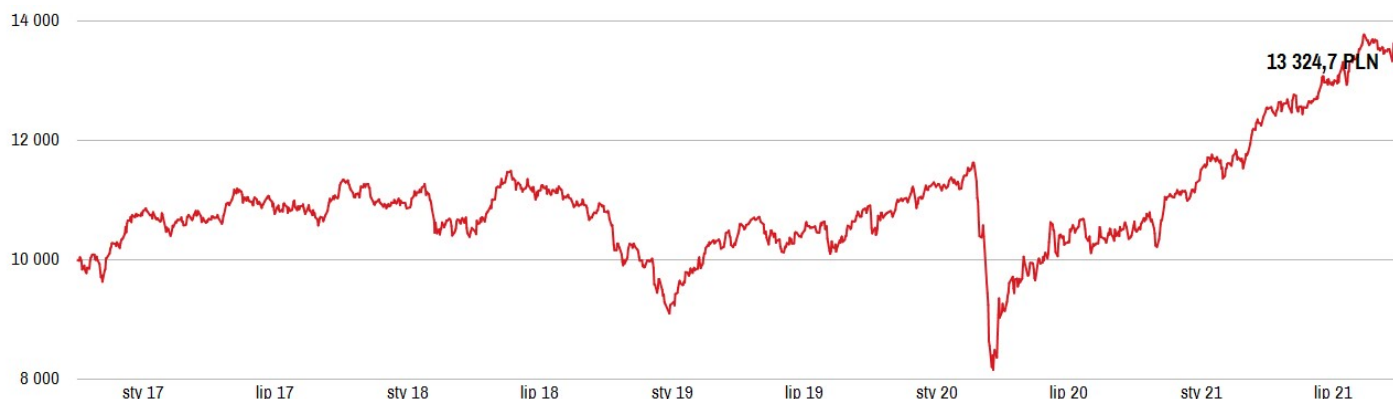
| | |
|---|--------|
| Udział instr. akcyjnych | 94,4 % |
| Udział pozostałych instr., w tym dłużnych | 5,6 % |
| Liczba instr. akcyjnych | 576 |
| Liczba instr. dłużnych | 16 |

Analiza ryzyka

| | |
|------|--------|
| Alfa | 0,03% |
| Beta | 0,9997 |



Wzrost wartości 10 000 PLN



Zespół odpowiedzialny za wyniki inwestycyjne

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

Komentarz

W odniesieniu do tytułów uczestnictwa poszczególnych funduszy zagranicznych 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,
- 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 udziałowym, zarządzający stosuje głównie metody ilościowe z możliwością uwzględnienia perspektywy fundamentalnej spółek. Metoda ilościowa ma na celu zaklasyfikowanie spółek do danej grupy, np. indeksu, sektora, segmentu rynku, umożliwiającą efektywne zarządzanie portfelem. W zakresie perspektywy fundamentalnej istotną będzie ocena potencjału do wzrostu poszczególnych sektorów lub grup sektorów oraz segmentów rynku rozumianych jako m.in. spółki o małej, średniej i dużej kapitalizacji, spółki o charakterze wzrostowym oraz wartościowym oraz spółki o charakterze defensywnym i cyklicznym, a także w ramach innych segmentów rynku dających możliwość oceny potencjału wzrostowego spółek.

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 subfunduszu.

Objaśnienia

Jeśli nie stwierdzono inaczej wszystkie informacje są aktualne na 30 września 2021 roku.

Prezentowane dane nie uwzględniają ekspozycji na instrumenty pochodne. Pekao Akcji Europejskich wchodzi jest subfunduszem wchodzącym w skład funduszu Pekao Walutowy FIO. Z uwagi na fakt, że subfundusz lokuje znaczną część aktywów w inne kategorie lokat niż dłużne papiery wartościowe lub instrumenty rynku pieniężnego tj. w tytuły uczestnictwa funduszy zagranicznych lub tytuły uczestnictwa instytucji wspólnego inwestowania mających siedzibę zagranicą inwestujących głównie w instrumenty finansowe o charakterze udziałowym, aktywa netto portfela inwestycyjnego funduszu mogą charakteryzować się dużą zmiennością.

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.

2021 **MSCI**. Wszelkie prawa zastrzeżone. Inwestycja w fundusz 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 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 0000016956, posługująca się numerem NIP 521 11 82 650. Kapitał zakładowy: 50 504 000 PLN, łączna kwota uiszczonych wkładów równa kapitałowi zakładowemu.