nationale nederlanden

Karta subfunduszu

Nationale-Nederlanden Subfundusz Akcji Polskich (wcześniej MetLife Subfundusz Akcji Polskich)

Czerwiec 2022

Informacja reklamowa

Informacja ma charakter marketingowy, nie stanowi umowy ani nie jest dokumentem informacyjnym wymaganym na mocy przepisów prawa oraz nie zawiera informacji wystarczających do podjęcia decyzji inwestycyjnych. Uczestnik nabywa jednostki uczestnictwa Subfunduszu, a nie aktywa bazowe będące przedmiotem inwestycji i własnością Subfunduszu. Wyniki osiągnięte w przeszłości nie przewidują przyszłych zwrotów. Przed podjęciem ostatecznych decyzji inwestycyjnych należy zapoznać się z Prospektem Informacyjnym i Kluczowymi Informacjami dla Inwestorów.

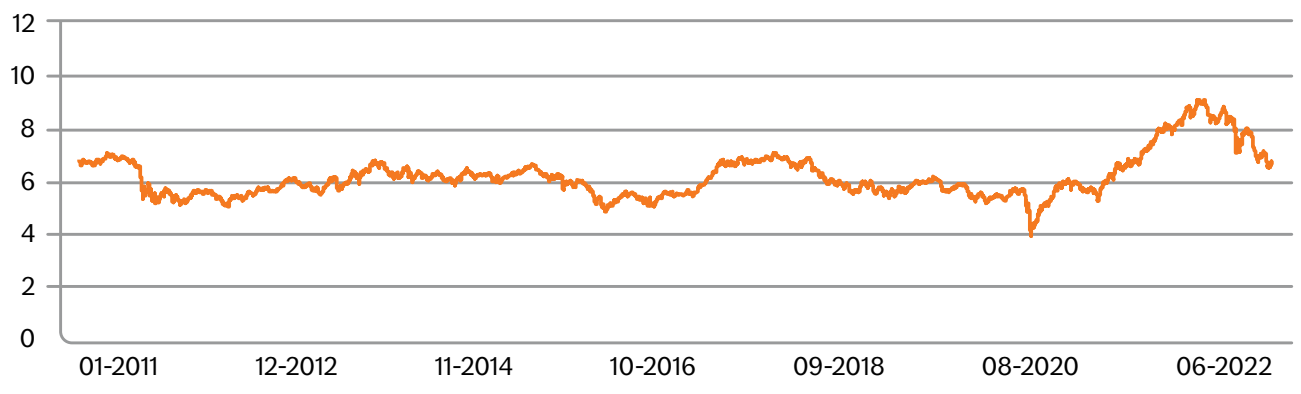
Polityka inwestycyjna

- Nationale-Nederlanden Subfundusz Akcji polskich inwestuje w akcje spółek mających siedzibę w Polsce; zaangażowanie nie może być mniejsze niż 66% aktywów.
- Inwestycje w akcje zagraniczne mogą stanowić maksymalnie 30% aktywów. Pozostała część środków lokowana jest na krótkoterminowych lokatach bankowych lub rachunkach bieżących.
- Subfundusz może zawierać umowy na instrumentach pochodnych.
- W skład portfela Subfunduszu mogą wchodzić instrumenty ETF lub kontrakty terminowe.

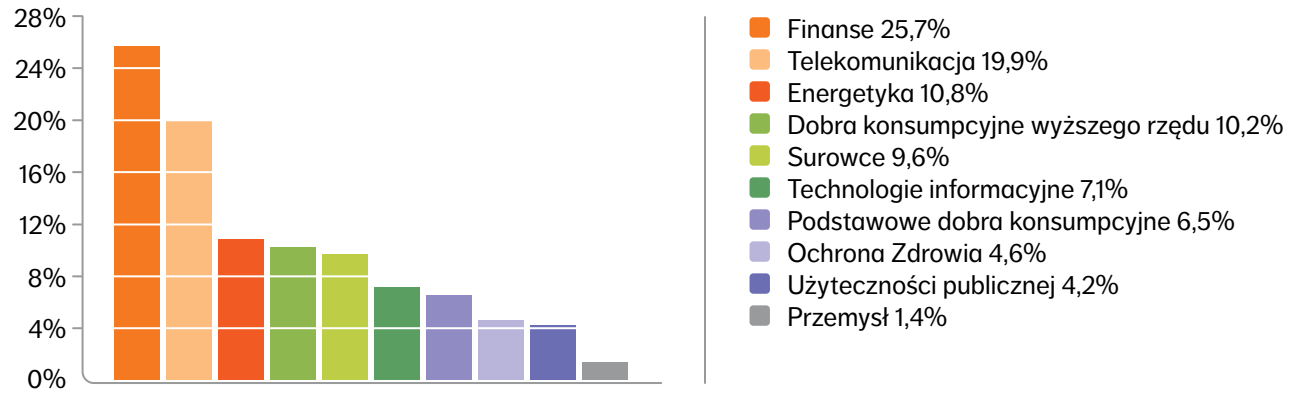
Podstawowe informacje o Subfunduszu i Towarzystwie

Data rozpoczęcia działalności przez TFI: 09.03.2004
Liczba strategii oferowanych przez TFI: 23
Typ Subfunduszu: Akcyjny Krajowy
Waluta: PLN
Region inwestowania: Polska
Benchmark: 50% WIG20, 40% mWIG40, 10% WIBID 1M
Zarządzający: Tomasz Adamus, Krzysztof Bednarczyk, Tomasz Karsznia, Izabela Owczarek
Data pierwszej wyceny Subfunduszu: 03.01.2011
Częstotliwość wyceny: każdy dzień roboczy GPW
Subfundusz Parasolowy: tak
Opłata dystrybucyjna (max): 4,50%
Opłata za zarządzanie (rzeczywista): 2,00%
Pierwsza wpłata: 500 PLN
Każda następna: 250 PLN
Wielkość aktywów Subfunduszu na dzień 30.06.2022: 18,3 mln PLN

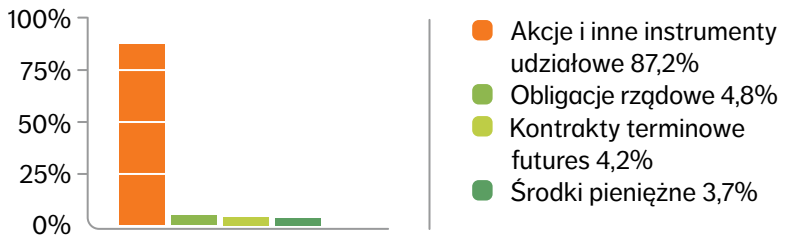
Zmiana wartości jednostek uczestnictwa Nationale-Nederlanden Subfunduszu Akcji Polskich



Alokacja sektorowa portfela akcyjnego Subfunduszu na dzień 30.06.2022



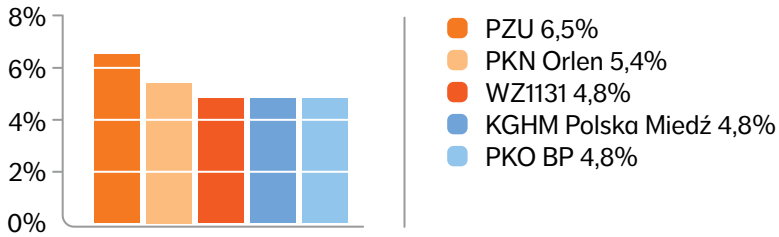
Struktura portfela na dzień 30.06.2022



Ekspozycja walutowa na dzień 30.06.2022

PLN 100%

Największe pozycje na dzień 30.06.2022



Miary ryzyka Subfunduszu na dzień 30.06.2022

Współczynnik Sharpe'a 0,070
Współczynnik ß 0,89
Tracking Error 7,42%

Wyniki inwestycyjne Nationale-Nederlanden Subfunduszu Akcji Polskich i Benchmarku na dzień 30.06.2022

	1M	3M	1 rok	2 lata	3 lata	5 lat	10 lat	YTD
Subfundusz	-6,5%	-16,1%	-16,8%	15,7%	13,1%	-1,9%	21,4%	-21,7%
Benchmark	-6,5%	-16,0%	-17,8%	5,4%	-13,4%	-19,3%	19,9%	-21,6%

Dane źródłowe: Obliczenia własne Nationale-Nederlanden TFI S.A.

Informacje o ryzyku i zastrzeżenia prawne

Niniejsze opracowanie wyraża wiedzę oraz poglądy jego autorów, według stanu na dzień jego sporządzenia i ma wyłącznie charakter informacyjny. Przedmiotowe opracowanie nie powinno stanowić podstawy do podejmowania jakichkolwiek decyzji inwestycyjnych. Autorzy oraz Nationale-Nederlanden Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. nie ponoszą odpowiedzialności za jakiekolwiek decyzje inwestycyjne podjęte na podstawie niniejszego opracowania. Niniejszy materiał nie stanowi rekomendacji inwestycyjnej. Nationale-Nederlanden Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. i Fundusze Inwestycyjne zarządzane przez Nationale-Nederlanden Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. nie gwarantują osiągnięcia założonego celu inwestycyjnego ani uzyskania określonego wyniku inwestycyjnego.

Historyczne wyniki inwestycyjne Funduszy Inwestycyjnych nie stanowią gwarancji osiągnięcia podobnych wyników inwestycyjnych w przyszłości. Inwestycje w Fundusze Inwestycyjne są obarczone ryzykiem inwestycyjnym, włącznie z możliwością utraty przynajmniej części zainwestowanego kapitału. Indywidualna stopa zwrotu z inwestycji w dany Subfundusz jest uzależniona od daty zbycia oraz odkupienia jednostek uczestnictwa, wysokości pobranych opłat manipulacyjnych oraz obowiązków podatkowych uczestnika.

Powyżej 35% wartości aktywów poszczególnych Subfunduszy Nationale-Nederlanden FIO (nie dotyczy Nationale-Nederlanden Subfunduszu Globalnych Innowacji, Nationale-Nederlanden Subfunduszu Multistrategia) oraz aktywów poszczególnych Subfunduszy Krajowych Nationale-Nederlanden SFIO może być lokowane w papiery wartościowe emitowane, poręczane lub gwarantowane przez Skarb Państwa, Narodowy Bank Polski. Aktywa Subfunduszy Zagranicznych Nationale-Nederlanden SFIO lokowane są w większości w jednostki uczestnictwa zagranicznych subfunduszy wskazanych w Statucie Nationale-Nederlanden SFIO (nie dotyczy Nationale-Nederlanden Subfunduszu Akcji Europejskich oraz Nationale-Nederlanden Subfunduszu Akcji Ameryki Łacińskiej). Wartość aktywów netto: Subfunduszy Nationale-Nederlanden FIO (nie dotyczy Nationale-Nederlanden Subfunduszu Obligacji Skarbowych, Nationale-Nederlanden Subfunduszu Konserwatywnego), Subfunduszy Krajowych Nationale-Nederlanden SFIO (nie dotyczy Nationale-Nederlanden Subfunduszu Konserwatywnego Plus i Nationale-Nederlanden Subfunduszu Obligacji Plus) oraz Subfunduszy Zagranicznych Nationale-Nederlanden SFIO (nie dotyczy Nationale-Nederlanden Subfunduszu Obligacji Światowych), cechuje się dużą zmiennością ze względu na skład portfela inwestycyjnego Subfunduszu lub na stosowane techniki zarządzania tym portfelem.

Szczegółowe informacje, w tym szczegółowy opis czynników ryzyka, znajdują się w Prospekcie Informacyjnym i Kluczowych Informacjach dla Inwestorów Nationale-Nederlanden SFIO oraz w Prospekcie Informacyjnym i Kluczowych Informacjach dla Inwestorów Nationale-Nederlanden FIO, dostępnych na stronie internetowej www.nn.pl oraz u podmiotów prowadzących dystrybucję.

Profil ryzyka KIID to profil ryzyka Subfunduszu wyrażony syntetycznym wskaźnikiem ryzyka (profil ryzyka i zysku), który obrazuje poziom historycznych wahań Jednostki Uczestnictwa mierzony odchyleniem standardowym tygodniowych stóp zwrotu z jednostki uczestnictwa za okres obejmujący 5 lat działalności funduszu. Dane historyczne, takie jak dane stosowane przy obliczaniu wskaźnika syntetycznego, nie dają pewności co do przyszłego profilu ryzyka Subfunduszu. Ze względu na swoją konstrukcję syntetyczny wskaźnik ryzyka nie obejmuje szeregu ryzyk występujących w Subfunduszu, ryzyka istotne dla poszczególnych subfunduszy zostały wymienione w dokumencie Kluczowe Informacje dla Inwestorów. Nie ma gwarancji, że wskazana kategoria profilu ryzyka i zysku pozostanie niezmienna. Przypisanie Subfunduszu do określonej kategorii może z czasem ulec zmianie. Najniższa kategoria ryzyka nie oznacza inwestycji wolnych od ryzyka. Kategoria „Największe pozycje" prezentuje największe pozycje w portfelu spośród akcji, obligacji oraz jednostek uczestnictwa.

Słowniczek

Beta to miara wskazująca wrażliwość zmiany ceny badanego instrumentu w porównaniu ze zmianą benchmarku, np. indeksu akcji. Wskaźnik równy jedności oznacza, że spodziewany 10% wzrost lub spadek wartości wzorca przełoży się na 10% wzrost lub spadek wartości badanego instrumentu (wartości jednostki w przypadku funduszy). Im wyższą wartość przyjmuje wskaźnik beta, tym bardziej ryzykowna jest rozpatrywana inwestycja. Ujemna beta oznacza odwrotne zachowanie się wartości jednostki w stosunku do zmiany wartości benchmarku.

Duration jest jedną z podstawowych miar oceny ryzyka portfela obligacji. Określa on ryzyko zmiany wartości portfela obligacji przy zmianie stóp procentowych. Im wyższy wskaźnik tym większe ryzyko straty w przypadku wzrostu stóp procentowych, a jednocześnie większy potencjalny zysk w przypadku obniżki stóp procentowych.

Wskaźnik Sharpe'a jest jedną z podstawowych miar oceny ryzyka funduszy. Współczynnik Sharpe'a najkrócej można zobrazować jako współczynnik premii uzyskiwanej przez inwestora w stosunku do możliwego zysku bez ryzyka. Im wyższy wskaźnik tym lepiej dla inwestora. Współczynnik Sharpe'a liczy się jako różnica stopy zwrotu portfela lub funduszu i stopy wolnej od ryzyka w stosunku do ryzyka całkowitego określane poprzez zmienność funduszu (odchylenie standardowe). Wskaźnik liczony jest w oparciu o miesięczne stopy zwrotu od momentu pierwszej wyceny funduszu, pod warunkiem, iż fundusz istnieje przynajmniej 24 miesiące.

Benchmark jest portfelem wzorcowy stanowiącym punkt odniesienia w ocenie wyników zarządzającego funduszem. W skład Benchmarku mogą wchodzić pojedyncze instrumenty finansowe, dla funduszy tzw. jednorodnych (np. funduszy akcji), bądź ich kombinacje dla funduszy mieszanych (np. funduszy zrównoważonych).

Tracking Error to wskaźnik pozwalający dokonać oceny zgodności efektów prowadzonej przez zarządzającego polityki inwestycyjnej z wynikami osiąganymi przez benchmark. Wskaźnik bazuje na odchyleniu standardowym dodatkowych stóp zwrotu (czyli sumy różnic wyników funduszu wobec wyników portfela wzorcowego/ benchmarku).

Im mniejsza wartość wskaźnika tym fundusz cechuje się niższym ryzykiem w stosunku do benchmarku, co oznacza niższe prawdopodobieństwa nie osiągnięcia wyniku jaki osiągnął benchmark. Wskaźnik liczony jest w oparciu o miesięczne stopy zwrotu od momentu pierwszej wyceny funduszu, pod warunkiem, iż fundusz istnieje przynajmniej 24 miesiące.

Inne istotne informacje

1 sierpnia 2022 zmieniliśmy nazwę MetLife TFI S.A. na Nationale-Nederlanden TFI S.A. O tym, co ważne, mówimy wprost - warunki umów oraz nasze zobowiązania wobec klientów i partnerów nie zmieniają się. Nadal będziemy dbać o najwyższy poziom obsługi naszych klientów. Dlatego w razie pytań dotyczących funduszy inwestycyjnych Nationale-Nederlanden TFI S.A. (wcześniej MetLife TFI S.A.) prosimy o kontakt z nami. Nasze dane kontaktowe są dostępne na www.nn.pl/kontakt.

Nationale-Nederlanden Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. (Nationale-Nederlanden TFI S.A.), ul. Przemysłowa 26, 00-450 Warszawa, zarejestrowane przez Sąd Rejonowy dla m.st. Warszawy, XII Wydział Gospodarczy Krajowego Rejestru Sądowego, pod nr KRS 0000181644; NIP 107-000-00-46; wysokość kapitału zakładowego: 17.190.000,00 złotych, wpłacony w całości. Nationale-Nederlanden TFI S.A. jest spółką z Grupy NN.