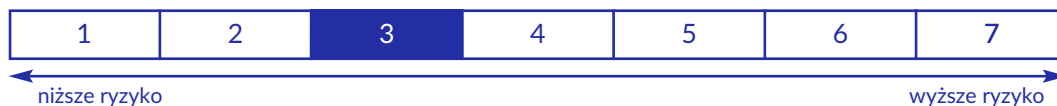


ESALIENS GLOBALNYCH PAPIERÓW DŁUŻNYCH

ryzyko inwestycyjne



Prezentowany wskaźnik ryzyka pochodzi z Kluczowych Informacji (KID). Wskaźnik wyznaczany jest w oparciu o historyczną zmienność stóp zwrotu subfunduszu wynikająca z realizowanej polityki inwestycyjnej i w przyszłości może ulec zmianie. Nawet najniższa kategoria ryzyka nie oznacza, że subfundusz jest pozbawiony ryzyka. Pozostałe ryzyka związane z inwestowaniem w subfundusz, których nie uwzględnia wskaźnik, przedstawiane są w Kluczowych Informacjach (KID) oraz Prospektach Funduszy.

profil inwestora

Subfundusz jest przeznaczony dla Inwestora, który:

- dąży do osiągnięcia stopy zwrotu wyższej od indeksów globalnych rynków papierów dłużnych w okresach 2-letnich,
- poszukuje funduszu o aktywnej i elastycznej polityce inwestycyjnej typu opportunity,
- akceptuje umiarkowane ryzyko inwestycyjne, związane z inwestycjami w skarbowe i nieskarbowe papiery dłużne, emitowane w różnych krajach i denominowane w różnych walutach.

Subfundusz może być przeznaczony między innymi do systematycznego oszczędzania w ramach długoterminowych programów oszczędnościowych i emerytalnych (CPO, IKE, IKZE). Ocena wyników zarządzania powinna być dokonywana przez Inwestora w okresie nie krótszym niż 2 lata.

 cel i polityka inwestycyjna subfunduszu

Struktura modelowa: 100% – tytuły uczestnictwa subfunduszu **FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund**, wyodrębnionego w ramach Franklin Templeton Global Funds plc (funduszu inwestycyjnego, zarejestrowanego w Irlandii). Subfundusz bazowy inwestuje przede wszystkim w dłużne papiery wartościowe denominowane w dolarach amerykańskich, jenach japońskich, funtach brytyjskich, euro oraz innych walutach z rynków rozwiniętych, jak i rozwijających się.

Celem inwestycyjnym subfunduszu jest wzrost wartości aktywów subfunduszu w wyniku wzrostu wartości lokat. Subfundusz dąży do osiągnięcia wyników jak najbardziej zbliżonych do osiąganych przez FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund.

Subfundusz jest aktywnie zarządzany.

Tytuły uczestnictwa w subfunduszu bazowego są nabywane przez subfundusz w PLN i powinny być zabezpieczone przed ryzykiem walutowym w stosunku do waluty subfunduszu bazowego.

 informacje o subfunduszu

Typ subfunduszu	dłużny
Data pierwszej wyceny	9.10.2015 r.
Minimalna wpłata	100 zł
Maksymalna opłata manipulacyjna	3,2 %
Opłata za zarządzanie (pobierana w skali roku)	1,89 %
Wartość jednostki uczestnictwa kategorii A	101,26 zł
Benchmark	brak
Jednostka uczestnictwa	PLN (hedged)
Waluta subfunduszu bazowego	USD
Aktywa subfunduszu bazowego	222.16 mln USD

 wyniki subfunduszu na 30.09.2023 r.

	1m	3m	6m	12m	36m	60m	120m	ytd
jednostka A	-1,69%	-1,78%	-0,18%	5,58%	-8,35%	-3,56%	b.d.	0,51%
	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	od początku działalności
	9.91%	4.53%	-7.17%	8.55%	2.99%	-3.02%	-9.98%	0.81%

Wyniki osiągnięte w przeszłości nie przewidują przyszłych zwrotów.

 alokacja aktywów na 30.09.2023 r.

subfundusz bazowy	depozyty, gotówka, inne
87.47%	12.53%

 informacje o subfunduszu bazowym na 31.08.2023 r.

subfundusz bazowy – FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

 jakość kredytowa (%)

AAA	20,44
AA	1,23
A	7,54
BBB	29,96
BB	22,69
B	10,60
CCC	1,39
CC	0,79
C	0,41
Bez oceny inwestycyjnej (ratingu)	0,17
Środki pieniężne i ich ekwiwalenty	4,77

 alokacja według krajów (%)

USA	47,70
Wielka Brytania	8,58
Meksyk	5,73
Indonezja	3,46
Brazylia	2,85
Inne	2,66
Francja	2,38
Pozostałe, w tym środki pieniężne i ich ekwiwalenty	26,64

 ekspozycja w podziale na waluty
(% portfela wg wartości rynkowej)

Dolar USA	86,97
Jen japoński	3,00
Peso meksykańskie	2,96
Rupia indonezyjska	2,67
Rand południowoafrykański	1,46
Real brazylijski	1,35
Złoty polski	0,99
Dolar australijski	0,94
Rubel rosyjski	0,79
Pozostałe	-1,13

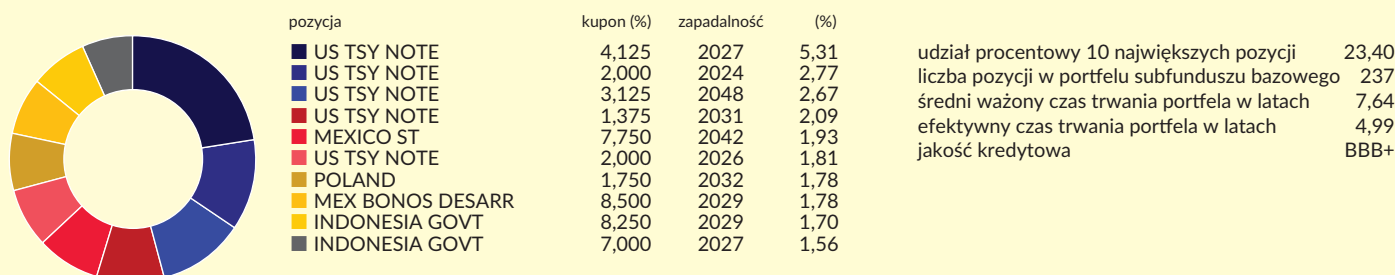
rodzaje instrumentów (%)

Papiery rządowe	20,44
Obligacje korporacyjne USA	15,23
Instrumenty dłużne rynków wschodzących – emitenci długu państwowego (w walucie lokalnej)	13,47
Obligacje korporacyjne wysokodochodowe (<i>high yield</i>) USA	10,98
Obligacje korporacyjne wysokodochodowe (<i>high yield</i>) EUR/UK	9,43
Obligacje korporacyjne rynków wschodzących	6,45
Obligacje korporacyjne EUR/UK	5,58
Instrumenty dłużne rynków wschodzących USD	4,62
Pożyczki bankowe USA	3,34
Pozostałe, w tym środki pieniężne i ich ekwiwalenty	10,46

ESALIENS GLOBALNYCH PAPIERÓW DŁUŻNYCH

i informacje o subfunduszu bazowym na 31.08.2023 r. (cd.)

10 największych pozycji (%)



Jakość kredytowa, alokacja według krajów, ekspozycja w podziale na waluty, rodzaje instrumentów, 10 największych pozycji oraz czas trwania portfela – dane dotyczą subfunduszu bazowego na 31.08.2023 r.

Wartości procentowe odnoszą się do całości portfela subfunduszu bazowego na koniec miesiąca i mogą ulegać zmianie w każdej chwili.

definicje

Średni ważony czas trwania portfela: Średnia liczba lat, podczas których każdy składnik portfela będzie pozostawał do zapłaty. Wskaźnik ten pokazuje, ile lat potrzeba, aby spłacić połowę kapitału pozostającego do zapłaty z tytułu portfela obligacji.

Efektywny czas trwania portfela: Efektywny czas trwania wskazuje wrażliwość cen obligacji w portfelu na zmianę stóp procentowych. Im dłuższy czas trwania, tym większa wrażliwość portfela na zmiany stóp procentowych.

Jakość kredytowa: Ocena prawdopodobieństwa niedotrzymania zobowiązań przez emitentów obligacji w zakresie płatności kuponu lub płatności kapitału. Ocena jest wydawana przez jedną lub kilka agencji ratingowych (Standard & Poor's, Moody's Investor Services oraz Fitch Ratings, Ltd.). Im niższy ogólny rating kredytowy, tym większe ryzyko związane z portfelem. Ocena kredytowa jest wyrażana symbolem literowym (od wysokiej do niskiej jakości): AAA, AA, A, BBB, BB, ... D.

ważne informacje

Jest to informacja reklamowa. Niniejszy materiał nie zawiera informacji wystarczających do podjęcia decyzji inwestycyjnej. Promowana inwestycja dotyczy nabycia jednostek uczestnictwa. Informacje na temat ESALIENS Subfunduszu Globalnych Papierów Dłużnych („subfundusz”), wydzielonego w ramach ESALIENS Parasol Zagraniczny SFIO („fundusz”) zawarte są w prospekcie informacyjnym i w Kluczowych Informacjach (KID), które są dostępne na stronie internetowej www.esaliens.pl, w określonych punktach dystrybucji funduszu, jak również w formie pisemnej w siedzibie funduszu (Warszawa, ul. Warecka 11a). Prospekt informacyjny funduszu oraz Kluczowe Informacje (KID) zawierają informacje niezbędne do oceny inwestycji, wskazują ryzyko uczestnictwa w funduszu, koszty, opłaty i informacje o podatkach. Przed zainwestowaniem w subfundusz należy zapoznać się z Kluczowymi Informacjami (KID) dotyczącymi wybranej kategorii jednostki uczestnictwa subfunduszu, jak również z prospektem informacyjnym funduszu.

Dotychczasowe wyniki subfunduszu nie stanowią gwarancji osiągnięcia podobnych wyników w przyszłości. Wyniki subfunduszu nie uwzględniają podatku od dochodów kapitałowych oraz opłat związanych z nabywaniem jednostek uczestnictwa. Indywidualna stopa zwrotu zależy od dnia nabycia oraz odkupienia jednostek uczestnictwa, a także od wielkości pobranych opłat manipulacyjnych i wysokości należnego podatku. Fundusz nie gwarantuje realizacji założonego celu inwestycyjnego subfunduszu, ani uzyskania określonego wyniku inwestycyjnego. Uczestnik funduszu musi liczyć się z możliwością utraty przynajmniej części wpłaconych środków. Fundusz lokuje aktywa subfunduszu głównie w lokaty inne niż papiery wartościowe (z zastrzeżeniem tytułów uczestnictwa funduszy zagranicznych) lub instrumenty rynku pieniężnego. Fundusz lokuje aktywa subfunduszu głównie w tytuły uczestnictwa subfunduszu FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund, wyodrębnionego w ramach Franklin Templeton Global Funds plc. Subfundusz bazowy, stanowiący podstawowy przedmiot lokat, określony jest w prospekcie informacyjnym funduszu. Wartość aktywów netto subfunduszu może cechować się znaczną zmiennością ze względu na skład portfela inwestycyjnego. Niniejszy materiał ma wyłącznie charakter reklamowy, a wykresy, diagramy i zestawienia w nim zawarte należy traktować jako ilustrację, nie prognozę. Materiał ten nie stanowi oferty w rozumieniu Kodeksu cywilnego ani oferty publicznej w rozumieniu ustawy o ofercie publicznej i warunkach wprowadzania instrumentów finansowych do zorganizowanego systemu obrotu oraz o spółkach publicznych, doradztwa inwestycyjnego, innego rodzaju doradztwa, ani rekomendacji do zawarcia transakcji kupna lub sprzedaży jakiegokolwiek instrumentu finansowego, jak również innych informacji rekomendujących lub sugerujących strategię inwestycyjną. Źródło danych – obliczenia własne ESALIENS TFI SA, a w części dotyczącej subfunduszu bazowego – oficjalne materiały tego subfunduszu, stan na dzień sporządzenia niniejszego materiału. ESALIENS TFI SA, które zarządza funduszem ESALIENS Parasol Zagraniczny SFIO, działa na podstawie decyzji z dnia 18.06.1998 r., wydanej przez Komisję Papierów Wartościowych i Giełd (obecnie Komisja Nadzoru Finansowego).