

Santander Prestiż Alfa

Santander Prestiż SFIO

STYCZEŃ 2021

PODSTAWOWE INFORMACJE

kategoria	ABSOLUTNEJ STOPY ZWROTU
sugerowany czas inwestycji	co najmniej 3 lata
minimalna pierwsza wpłata	10 000 PLN
minimalna kolejna wpłata	1 000 PLN
opłata za nabycie (dystrybucyjna)	0,0% (promocja)
opłata za odkupienie (manipulacyjna)	0,0% (promocja)
opłata za zamianę między subfunduszami (dodatkowa)	0,0% (promocja)
aktualna opłata za zarządzanie	B: 2,0%
maksymalna opłata za zarządzanie	B: 2,5%
opłata za wyniki	2,0%
benchmark	WIBID 3M
data rozpoczęcia działalności	30.01.2018

SKRÓCONY OPIS POLITYKI INWESTYCYJNEJ I RYZYKA

- subfundusz stosuje m.in. strategię "market neutral", która powinna prowadzić do ograniczenia ryzyka rynkowego związanego z rynkiem akcji,
- subfundusz lokuje pomiędzy od 40% do 70% w akcje przy jednoczesnym zabezpieczaniu pozycji za pomocą kontraktów terminowych na wybrane indeksy giełdowe,
- udział dłużnych papierów wartościowych stanowi do 60% aktywów, z czego maksymalnie 40% aktywów subfunduszu mogą stanowić obligacje korporacyjne, co najmniej 50% aktywów stawia aktywa krajowe,
- subfundusz jest dedykowany dla inwestorów, którzy oczekują ponadprzeciętnych zysków i planują inwestowanie średnio- lub długoterminowe (minimum 3-letnie) oraz akceptują średni poziom ryzyka związanego głównie z ryzykiem specyficznym spółek, a także z ryzykiem kredytowym i ryzykiem płynności możliwe okresowe duże wahania cen jednostki uczestnictwa. W okresach kryzysów wywołanych różnymi czynnikami ryzyko płynności i ryzyko kredytowe istotnie rosną i mogą się przyczynić do znaczących strat dla Inwestora. Pełen opis ryzyk subfunduszu znajduje się w prospekcie informacyjnym oraz, w skróconej formie, w kluczowych informacjach dla inwestorów.

Proces inwestycyjny w Santander TFI opiera się zarówno na kompetencjach Komitetu Inwestycyjnego jak i zarządzających poszczególnymi subfunduszami. Komitet Inwestycyjny, w skład którego wchodzi wszyscy zarządzający, akceptuje instrumenty finansowe, które mogą znajdować się w portfelach subfunduszy oraz podejmuje decyzje kierunkowe dotyczące zarządzanych portfeli. Zarządzający subfunduszami podejmują decyzje inwestycyjne dotyczące docelowych udziałów poszczególnych instrumentów finansowych w portfelu.

ZARZĄDZAJĄCY



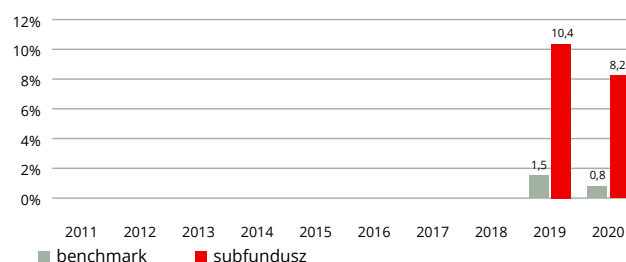
Jakub Płotka
Zarządzający Funduszami

WYNIKI (dane na 2021-01-29)

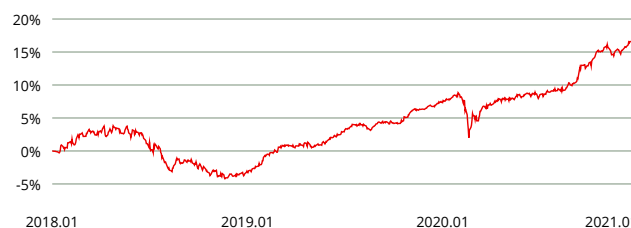
Stopy zwrotu

	1M	3M	6M	1Y	3Y	5Y	10Y	YTD
jedn. B	1,7%	3,4%	8,0%	8,9%	17,2%	N/D	N/D	1,7%
benchmark	0,0%	0,0%	0,0%	0,7%	3,8%	N/D	N/D	0,0%

Stopy zwrotu w ostatnich 10 latach kalendarzowych (jedn. B,%)



Stopa zwrotu od początku działalności (jedn. B,%)



RYZYKO

Wskaźnik SRRI



Wskaźniki ryzyka i efektywności

	1Y	3Y	5Y
odchylenie standardowe	1,70%	1,36%	N/D
wskaźnik Sharpe'a	0,41	0,27	N/D
wskaźnik alfa	1,14%	1,14%	N/D
wskaźnik beta	-8,22	-8,21	N/D
wskaźnik R ²	0,15	0,09	N/D
tracking error	1,87%	1,43%	N/D

SKŁAD PORTFELA (dane na 2021-01-29)

Największe inwestycje

	Typ	Udział
BGK/PLN/20300605	D	23,1%
KGHM Polska Miedź S.A.	U	4,8%
Powszechna Kasa Oszczędności Bank Polski S.A.	U	4,4%
WZ1122	D	4,3%
Powszechny Zakład Ubezpieczeń S.A.	U	3,6%
Bank Polska Kasa Opieki S.A.	U	3,4%
Dino Polska S.A.	U	2,7%
RHI Magnesita N.V.	U	2,4%
Polski Koncern Naftowy ORLEN S.A.	U	2,4%
Ams AG/EUR/20250731	D	2,3%

Największe pozycje w portfelu inwestycyjnym, wg stanu na 29.01.2021 r. Szczegółowe informacje znajdują się na Santander.pl/TFI

KATEGORIE JEDNOSTEK UCZESTNICTWA

W funduszu Santander Prestiż SFIO istnieją dwie kategorie jednostek uczestnictwa (JU): B i D, które różnią się między sobą wysokością opłaty za zarządzanie oraz opłaty za wyniki inwestycyjne. JU kategorii B zbywana jest za pośrednictwem dystrybutorów, natomiast JU kategorii D zbywana jest bezpośrednio przez Fundusz.

JU nabyte przed dniem 29 maja 2020 roku zostają z tym dniem oznaczone jako JU kategorii B. O rozpoczęciu zbywania JU kategorii D fundusz informuje na stronie Santander.pl/TFI.

PODMIOT ZARZĄDZAJĄCY

Santander Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. to jedno z największych i najbardziej doświadczonych TFI działających na polskim rynku. Od 1998 roku zarządzamy funduszami inwestycyjnymi cieszącymi się uznaniem Klientów i ekspertów. Powierzone przez naszych Klientów środki lokujemy, w zależności od wybranego funduszu i subfunduszu, w instrumenty rynku kapitałowego i finansowego: akcje, obligacje, instrumenty pieniężne.

INFORMACJE KONTAKTOWE

Santander TFI S.A.
pl. Władysława Andersa 5
61-894 Poznań

Santander.pl/TFI
tfi@santander.pl
tel. 801 123 801

WAŻNE INFORMACJE

Prezentowane dane dotyczą wartości jednostek uczestnictwa subfunduszu oraz zmian wartości jednostek uczestnictwa w podanych okresach, są danymi historycznymi i nie stanowią gwarancji uzyskania podobnych wyników w przyszłości. Wyniki te nie uwzględniają ewentualnego opodatkowania Uczestników oraz ponoszonych przez nich opłat z tytułu zbycia i odkupienia jednostek przez subfundusz. Dane finansowe subfunduszu, opis czynników ryzyka oraz informacje na temat opłat związanych z uczestnictwem w subfunduszu znajdują się w prospekcie informacyjnym oraz tabeli opłat dostępnych w języku polskim na Santander.pl/TFI i u dystrybutorów funduszu Santander Prestiż SFIO. Fundusz (subfundusz) nie gwarantuje realizacji założonego celu inwestycyjnego ani uzyskania określonego wyniku inwestycyjnego. Przed podjęciem decyzji inwestycyjnej Uczestnik powinien wziąć pod uwagę opłaty związane z subfunduszem oraz uwzględnić ewentualne opodatkowanie zysku. Uczestnik musi liczyć się z możliwością utraty przynajmniej części wpłaconych środków. Wartość aktywów netto subfunduszu może cechować się dużą zmiennością ze względu na skład portfela inwestycyjnego. Subfundusz może inwestować więcej niż 35% aktywów w papiery wartościowe emitowane, gwarantowane lub polecane przez Skarb Państwa lub NBP. Powyższy materiał ma wyłącznie charakter promocyjny. 2021 © Santander Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych Spółka Akcyjna. Wszelkie prawa zastrzeżone. Nazwa Santander i logo „płomień” są zarejestrowanymi znakami towarowymi.

Dane aktualne na dzień generowania karty – 2021-02-17

Niniejszy materiał został przygotowany przez firmę Analizy Online S.A.

Klasy aktywów



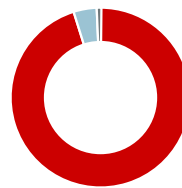
50% akcje zabezpieczone kontraktami
27% obligacje skarbowe
23% obligacje korporacyjne

Geografia



69% Polska
9% Holandia
5% Austria
4% Wielka Brytania
3% Stany Zjednoczone
10% pozostałe

Waluty



95% PLN
4% GBP
1% USD

OBJAŚNIENIA DOTYCZĄCE POJĘĆ I SKRÓTÓW UŻYTYCH W DOKUMENCIE

W kolumnie Typ w tabeli "Największe inwestycje" wskazany jest typ, do jakiego zalicza się dana pozycja; wartości w tej kolumnie oznaczają odpowiednio:

U - papiery **udziałowe**: akcje i instrumenty o podobnym charakterze, np. kwity depozytowe, prawa do akcji itd.

D - papiery **dłużne**: obligacje, listy zastawne i certyfikaty depozytowe

F - certyfikaty inwestycyjne i tytuły uczestnictwa **funduszy** inwestycyjnych

P - **pozostałe**

Benchmark - punkt odniesienia dla oceny stóp zwrotu danego subfunduszu, biorący pod uwagę specyfikę jego polityki inwestycyjnej. Benchmarkiem dla funduszu akcji inwestującego na polskiej giełdzie może być np. indeks WIG, a dla funduszu rynku pieniężnego rentowność bonów skarbowych. Benchmarki mogą być konstruowane w oparciu o wiele wskaźników jednocześnie, na przykład gdy fundusz inwestuje na wielu rynkach

Alfa - mierzy związek między aktualnymi wynikami funduszu a wynikami, które zostałyby osiągnięte z racji samych ruchów rynkowych. Innymi słowy alfa mierzy wartość dodaną uzyskiwaną z zarządzania portfelem przez specjalistów.

Beta - mierzy zależność pomiędzy zmiennością funduszu a benchmarkiem. Fundusz z betą 1.00 jest uznawany za fundusz o podobnej zmienności do zmienności benchmarku. Fundusz z betą wyższą jest uznawany za bardziej zmienny niż benchmark, podczas gdy fundusz z betą niższą może wzrastać i spadać wolniej niż benchmark.

R² - mierzy w jakim zakresie charakter wyników funduszu jest kierowany przez benchmark. Np. fundusz z R² na poziomie 0,8 oznacza, że 80% historycznego zachowania funduszu jest przypisywane benchmarkowi.

Tracking error - oczekiwane bądź aktualne maksymalne odchylenie standardowe zysków funduszu od benchmarku w okresie 12, 36 oraz 60 miesięcy.

Odchylenie standardowe - odchylenie standardowe zysków funduszu pokazuje, jak bardzo całkowite zyski funduszu zmieniały się w przeszłości. Odchylenie standardowe jest szeroko używane jako podstawowa miara ryzyka. Pokazuje, jak roczne zwroty funduszu mogą się różnić od średniego rocznego zwrotu w dłuższym okresie. Jest szczególnie przydatne przy porównywaniu dwóch funduszy, aby pokazać, który jest bardziej zmienny. Im większe odchylenie standardowe, tym większa zmienność funduszu.

Wskaźnik Sharpe'a - mierzy zwrot funduszu w odniesieniu do ryzyka. Pokazuje współczynnik dodatkowego zwrotu funduszu (tj. zwrot ponad osiągnięty z aktywów wolnych od ryzyka, np. papierów skarbowych) do ryzyka funduszu (tj. odchylenia standardowego funduszu). Im wyższy ten współczynnik, tym lepsze wyniki funduszu w stosunku do ponoszonego przez fundusz ryzyka.