

Santander Prestiż Alfa

Santander Prestiż SFIO

SIERPIEŃ 2021

PODSTAWOWE INFORMACJE

kategoria	ABSOLUTNEJ STOPY ZWROTU
sugerowany czas inwestycji	co najmniej 3 lata
minimalna pierwsza wpłata	1 000 PLN
minimalna kolejna wpłata	100 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,
- 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



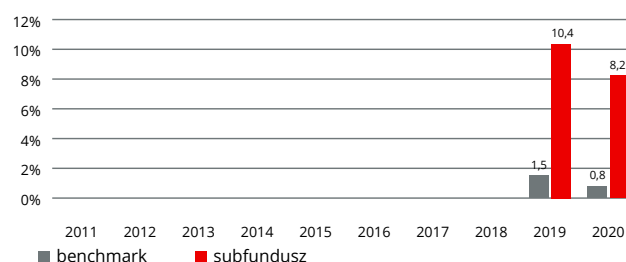
Jakub Płotka
Zarządzający Funduszami

WYNIKI (dane na 2021-08-31)

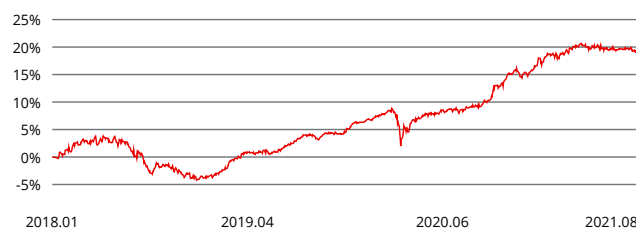
Stopy zwrotu

	1M	3M	6M	1Y	3Y	5Y	10Y	YTD
jedn. B	-0,6%	-1,0%	0,6%	8,9%	21,1%	N/D	N/D	3,1%
benchmark	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	2,9%	N/D	N/D	0,0%

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



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



RYZYKO

Wskaźnik SRRI



Wskaźniki ryzyka i efektywności

	1Y	3Y	5Y
odchylenie standardowe	1,14%	1,17%	N/D
wskaźnik Sharpe'a	0,63	0,40	N/D
wskaźnik alfa	0,55%	0,86%	N/D
wskaźnik beta	146,59	-4,01	N/D
wskaźnik R ²	0,07	0,06	N/D
tracking error	1,36%	1,28%	N/D

SKŁAD PORTFELA (dane na 2021-08-31)

Największe pozycje w portfelu

	Typ	Udział
BGK/PLN/20310612	D	15,1%
Powszechna Kasa Oszczędności Bank Polski S.A.	U	7,5%
WZ1122	D	7,1%
Depozyt/PLN/DM Banku Handlowego S.A.	G	6,0%
KGHM Polska Miedź S.A.	U	3,7%
Powszechny Zakład Ubezpieczeń S.A.	U	2,8%
Polski Koncern Naftowy ORLEN S.A.	U	2,7%
BGK/PLN/20300605	D	2,6%
Dino Polska S.A.	U	2,5%
RHI Magnesita N.V.	U	2,1%

Największe pozycje w portfelu inwestycyjnym, wg stanu na 31.08.2021 r. Szczegółowe informacje znajdują się na [Santander.pl/TFI](https://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](https://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

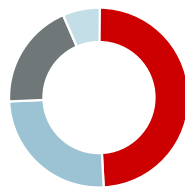
WAŻNE INFORMACJE

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, kluczowych informacjach dla inwestorów oraz tabeli opłat dostępnych w języku polskim na [Santander.pl/TFI/dokumenty](https://santander.pl/TFI/dokumenty) i u dystrybutorów funduszu Santander Prestiż SFIO. Streszczenie praw inwestorów znajduje się w prospekcie informacyjnym (Rozdział III, pkt 4). 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 poręczone 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 – 2021-09-16

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

Klasy aktywów



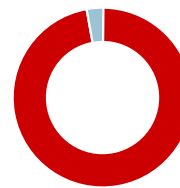
● 49% akcje zabezpieczone kontraktami
● 25% obligacje skarbowe
● 19% obligacje korporacyjne
● 7% środki pieniężne i depozyty

Geografia



● 74% Polska
● 7% Holandia
● 5% Stany Zjednoczone
● 4% Austria
● 3% Wielka Brytania
● 7% pozostałe

Waluty



● 97% PLN
● 3% GBP

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

G - środki pieniężne i depozyty

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 - miery związek między aktualnymi wynikami funduszu a wynikami, które zostałyby osiągnięte w racji samych ruchów rynkowych. Innymi słowy alfa miery zachowania funduszu z zarządzania portfelem przez specjalistów.

Beta - miery 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 - miery 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 zmieniły 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 - miery 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.