

NN INDEKS ODPOWIEDZIALNEGO INWESTOWANIA

INFORMACJA O FUNDUSZU

Polityka inwestycyjna

Fundusz realizuje swoje cele poprzez dążenie do odzwierciedlenia składu portfela oraz stopy zwrotu zbliżonej do indeksu WIG-ESG. Może inwestować do 100% aktywów w akcje spółek, które wchodzą w skład indeksu WIG-ESG, a także w instrumenty pochodne, dla których bazą są akcje spółek wchodzących w skład tego indeksu. Fundusz nie lokuje aktywów w instrumenty finansowe emitowane przez podmioty prowadzące działalność negatywnie oddziałującą na czynniki środowiskowe, społeczne i ładu korporacyjnego.

Profil inwestora

Fundusz przeznaczony jest dla inwestorów, którzy deklarują długoterminowy horyzont inwestycyjny (co najmniej 5 lat). Z uwagi na wysokie ryzyko, fundusz jest nieodpowiedni dla osób obawiających się ponoszenia strat w okresie zawirowań na rynkach finansowych. Aktywa funduszu są denominowane głównie w polskich złotych, ryzyko walutowe jest stosunkowo niskie.

RYZYKO

Ryzyko inwestycyjne

niższe ryzyko potencjalnie niższy zysk

wyższe ryzyko potencjalnie wyższy zysk



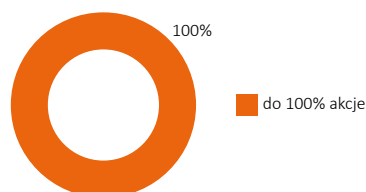
Profil ryzyka został wskazany na podstawie metodologii użytej w dokumencie: Kluczowe informacje dla inwestorów. Na podstawie danych historycznych użytych do przypisania kategorii ryzyka, nie można przewidzieć przyszłego profilu ryzyka Funduszu. Celem Funduszu nie jest osiągnięcie danej kategorii ryzyka. Profil ryzyka i zysku może w przyszłości ulegać zmianom. Najniższa kategoria ryzyka (1) nie oznacza, że inwestycja jest pozbawiona ryzyka.

dane na dzień 29.05.2020

Podstawowe informacje

Typ funduszu	akcyjny
Benchmark	WIG-ESG
Początek działalności funduszu	05.11.2001
Aktywa (29.05.2020)	1282,09 mln PLN
Wartość jednostki uczestnictwa	303,36 PLN
Minimalna pierwsza wpłata	200 PLN
Minimalna kolejna wpłata	50 PLN
Maksymalna opłata dystrybucyjna	4,00%
Opłata za zarządzanie	0,80%
Waluta funduszu	PLN
Waluta funduszu źródłowego	-

Modelowa struktura portfela



Rekomendowany minimalny horyzont inwestycyjny



WYNIKI

Zmiana wartości jednostek uczestnictwa

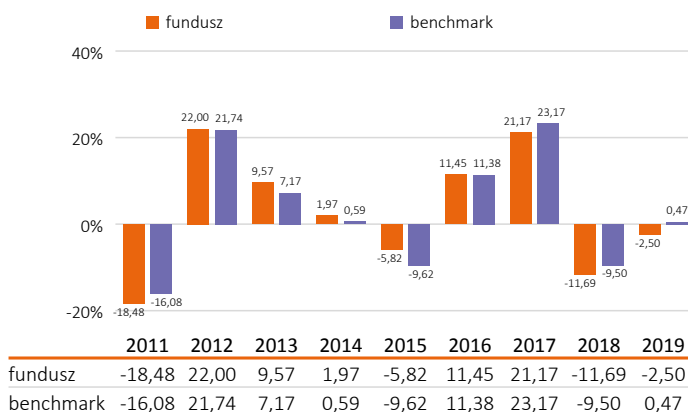
za okres od 05.11.2001 do 29.05.2020



Wyniki funduszu % na dzień 29.05.2020

	1 m	3 m	6 m	12 m	36 m	60 m	120 m	YTD	max
fundusz	3,24	-5,31	-19,42	-21,53	-26,86	-19,99	8,33	-19,97	200,24
benchmark	3,35	-4,77	-18,72	-19,38	-22,31	-15,93	11,78	-19,46	211,87

Wyniki roczne funduszu % dla poszczególnych lat



SKŁAD PORTFELA

Alokacja instrumentów finansowych dane na dzień 29.05.2020

nazwa	udział w portfelu
Akcje	99,16%
Gotówka i lokaty skorygowane o saldo należności i zobowiązań	0,84%

Otwarte pozycje walutowe dane na dzień 29.05.2020

nazwa	udział w portfelu
PLN	100,00%

Alokacja sektorowa dane na dzień 29.05.2020

nazwa	udział w portfelu
Finanse	36,12%
Energia	13,03%
Telekomunikacja	8,38%
Spółki konsumenckie	7,53%
Dobra codziennego użytku	6,75%
Surowce	5,72%
Spółki przemysłowe	3,26%
Spółki użyteczności publicznej	2,48%
inne	16,73%

Największe pozycje w portfelu

wg sprawozdania finansowego z dnia 31.12.2019

nazwa	udział w portfelu
Powszechna Kasa Oszczędności Bank Polski S.A.	9,02%
Powszechny Zakład Ubezpieczeń S.A.	8,67%
Polski Koncern Naftowy ORLEN S.A.	8,20%
CD Projekt S.A.	6,77%
Bank Polska Kasa Opieki S.A.	5,44%
LPP S.A.	5,40%
Santander Bank Polska S.A.	4,89%
KGHM Polska Miedź S.A.	4,32%
Cyfrowy Polsat S.A.	3,79%
Dino Polska S.A.	2,97%

Alokacja geograficzna dane na dzień 29.05.2020

nazwa	udział w portfelu
Polska	98,34%
Hiszpania	1,01%
Ukraina	0,65%

ZARZĄDZAJĄCY FUNDUSZEM



Michał Witkowski
Zarządzający Funduszami/ Starszy Analityk
Zespół Zarządzania Instrumentami Udziałowymi
13 lat w branży

Słownik

Odchylenie standardowe to jedna z bardziej popularnych miar statystycznych, pokazująca jak bardzo całkowite zyski funduszu zmieniały się w przeszłości. Im wyższe odchylenie standardowe, tym wyższe ryzyko towarzyszące inwestycji w jednostkę funduszu.

R², czyli kwadrat współczynnika korelacji liniowej Pearsona, to jedna z bardziej popularnych miar statystycznych, pokazująca stopień dopasowania serii danych do wzorca.

Wskaźnik Sharpe'a opisuje jak dobrze osiągnięta stopa zwrotu wynagradza inwestora za podjęte przez niego ryzyko inwestowania w walory ryzykowne. Parametr umożliwia jednoczesną maksymalizację zysku oraz minimalizację ryzyka, co można osiągnąć przez wybór funduszu o największej dodatniej wartości wskaźnika.

Wskaźnik Alfa Jensena to miara zysku skorygowana o ponoszone ryzyko. Jego dodatnia wartość wyraża nadwyżkę wyniku ponad oczekiwaną stopę zwrotu, jaka wynika z modelu wyceny aktywów kapitałowych (CAPM).

Beta to miara wskazująca wrażliwość zmiany ceny badanego instrumentu w porównaniu ze zmianą benchmarku. Wskaźnik równy 1 oznacza, że spodziewany 10% wzrost wartości wzorca przełoży się na 10% wzrost wartości badanego instrumentu (wartości jednostki w przypadku funduszy). Im wyższą wartość przyjmuje wskaźnik beta, tym bardziej ryzykowna jest rozpatrywana inwestycja.

Tracking Error pozwala dokonać oceny zgodności efektów prowadzonej przez zarządzającego polityki inwestycyjnej z wynikami osiąganymi przez benchmark. Im mniejsza jest wartość wskaźnika TE tym ewentualne powstałe różnice są mniejsze.

Rating Analiz Online to ocena funduszu opierająca się na ocenie czynników ilościowych (takich jak wyniki) oraz jakościowych. Analiza funduszu polega na dogłębnym zbadaniu czterech podstawowych obszarów, które decydują o obecnym zachowaniu funduszu oraz o zachowaniu w przyszłości: zarządzający i proces inwestycyjny, polityka inwestycyjna i portfel, charakterystyka portfela, wyniki funduszu i ryzyko oraz koszty i opłaty. Im więcej przyznanych gwiazdek tym lepiej oceniona jakość funduszu. W dużym uproszczeniu przyznanie 4 bądź 5 gwiazdek oznacza, iż fundusze te są warte zainteresowania w pierwszej kolejności, gdyż ich charakterystyka wskazuje na dużą zdolność do osiągania wyników lepszych od przeciętnej w grupie.

Benchmark wzorzec stanowiący punkt odniesienia do oceny wyników zarządzania aktywami funduszu. Jako benchmark mogą służyć między innymi: indeks giełdowy, inflacja, rentowność określonych bonów skarbowych lub ich odpowiednie kombinacje. WIG-ESG - indeks warszawskiej giełdy obejmujący największe spółki pochodzące z WIG20 oraz mWIG40, które prowadzą działalność odpowiedzialną społecznie.

Niniejszy materiał został przygotowany przez Analizy Online S.A. (analizyonline.pl) na zlecenie NN Investment Partners Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. i posiada charakter reklamowy. NN Investment Partners TFI posiada zezwolenie Komisji Nadzoru Finansowego na prowadzenie działalności. Podany w niniejszym dokumencie profil ryzyka funduszu jest oparty na metodologii stosowanej w Kluczowych Informacjach dla Inwestorów. Stopy zwrotu (źródło: Analizy Online S.A.) mają charakter historyczny. NN Investment Partners TFI i Fundusz nie gwarantują osiągnięcia celów inwestycyjnych ani uzyskania podobnych wyników w przyszłości. Inwestycje w Fundusz są obarczone ryzykiem inwestycyjnym, a Uczestnik musi liczyć się z istnieniem możliwości utraty części zainwestowanych środków. Indywidualna stopa zwrotu z inwestycji nie jest tożsama z wynikiem inwestycyjnym Funduszu i jest uzależniona od wartości jednostki uczestnictwa w momencie jej zbycia i odkupienia przez Fundusz oraz od wysokości pobranych opłat manipulacyjnych i należnych podatków. Tabele Opłat znajdują się na stronie www.nntfi.pl. Informacje o Funduszu oraz o jego ryzyku inwestycyjnym zawarte są w Prospekcie Informacyjnym dostępnym w siedzibie NN Investment Partners TFI i na stronie www.nntfi.pl oraz w Kluczowych Informacjach dla Inwestorów dostępnych w siedzibie NN Investment Partners TFI, u Dystrybutorów i na stronie www.nntfi.pl. Wartość aktywów netto Funduszu może się cechować dużą zmiennością, ze względu na inwestowanie aktywów Funduszu w akcje.