

# PROTEA UCITS II NAO PATRIMONIO GLOBAL

MARZO DE 2024

Comunicación de Marketing

## Características del fondo

Nombre	PROTEA UCITS II NAO PATRIMONIO GLOBAL
Nº Registro CNMV	2099
Categoría CNMV	Renta Variable Mixta Internacional
Horizonte temporal	3 años
Divisa	EUR
Fecha de registro	14/06/2023
Patrimonio Total (miles)	63.155,65
Índice de referencia (Benchmark)	35% EURO STOXX 50 Index, 15% SPX Index, 40% Bloomberg Barclays Series-E-Govt 3-5 Yr Bond Index y 10% 12m Euribor
Periodicidad del VL	Diario
Entidad Gestora	Nao Asset Management, E.S.G. SGIIC, S.A.
Entidad Depositaria	Bank Pictet & Cie (Europe) AG, Succ. Luxemburg
Auditor	Deloitte, S.L.
Enlace web Gestora	http://www.nao-sam.com
Clasificación Sostenibilidad (SFDR)	Artículo 6

## Nivel de riesgo<sup>1</sup>

1	2	3	4	5	6	7
Riesgo menor			Riesgo mayor			

<sup>1</sup> Este perfil de riesgo actual se basa en datos históricos. Los datos históricos pueden no ser un indicador fiable del futuro perfil de riesgo del Fondo. La categoría de riesgo indicada no está garantizada y puede variar a lo largo del tiempo. La calificación más baja no significa que la inversión esté libre de riesgos.

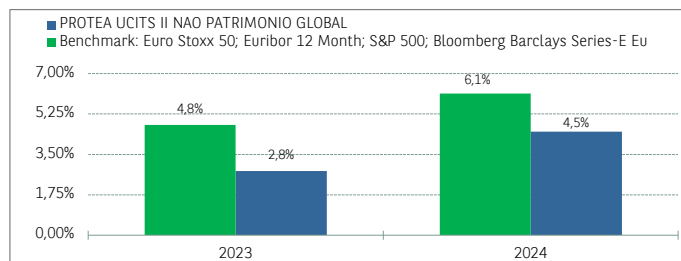
## Objetivo

El objetivo del subfondo es rentabilizar el capital con un horizonte temporal de medio plazo y un perfil de riesgo equilibrado. El vehículo cuenta con una cartera ampliamente diversificada que, compuesta por compañías que cumplen unos determinados criterios financieros y de sostenibilidad, quedará expuesta principalmente a Europa y Estados Unidos.

La información de riesgos está disponible en los KID (Key Information Document).

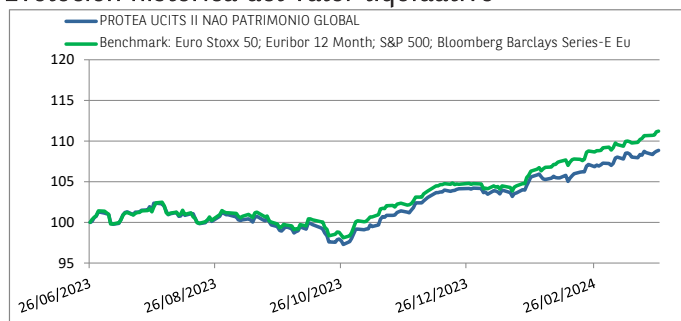
\* Los datos económicos (gráficos, rentabilidades y datos estadísticos) corresponden a la CLASE A

## Rendimiento anual vs Benchmark



Fuente: VL del fondo calculados por la Sociedad; Datos Benchmark obtenidos de Bloomberg

## Evolución histórica del valor liquidativo



Fuente: VL del fondo calculados por la Sociedad; Datos Benchmark obtenidos de Bloomberg

## Rendimientos mensuales

Año	Ene.	Feb.	Mar.	Abr.	May.	Jun.	Jul.	Ago.	Sep.	Oct.	Nov.	Dic.	Anual
2024	1,36%	1,38%	1,68%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	4,49%
2023	-	-	-	-	-	-0,09%	0,99%	-1,31%	-1,47%	-1,47%	3,88%	2,34%	2,78%

El rendimiento pasado no es una guía del rendimiento futuro. La rentabilidad futura está sujeta a fiscalidad que depende de la situación personal de cada inversor y que puede cambiar en el futuro.

## Clases de participaciones

	CLASE A	CLASE B
ISIN	LU2471066774	LU2705726771
Valor Liquidativo	107,39	103,66
Com. Gestión	0,75%	1,10%
Com. Depositario	0,07%	0,07%
TER <sup>2</sup>	1,08%	1,37%
Inversión Mínima	-	-
Fecha Creación	14/06/2023	23/01/2024

<sup>2</sup> Los gastos corrientes son los soportados por el fondo en el ejercicio precedente. No obstante, este importe podrá variar de un año a otro. Datos actualizados según el último informe anual disponible.

<sup>3</sup> Las cifras mostradas no incluyen todos los costes del producto en sí. Para más información, por favor consulte el folleto y otros documentos del fondo.

## Estadísticas

Rentabilidades	Estadísticas Rentabilidad / Riesgo		
Total desde inicio	7,39%	Mayor subida mensual	3,88%
Acumulada año 2024	4,49%	Mayor caída mensual	-1,47%
Último mes	1,68%	% Meses en positivo	60,00%
3 Últimos meses	4,49%	Volatilidad del Fondo	5,27%
12 Últimos meses	-	Volatilidad del Benchmark	5,27%
3 años (anualizada)	-	Beta	0,91
5 años (anualizada)	-	Correlación	0,91
		R2	0,83
		Alpha	-1,82
		Ratio Sharpe	1,33
		Tracking Error	2,25%
		Ratio Información	-1,20

\* El fondo ha empezado a desarrollar su política de inversión actual el 26/06/23 por lo que no están disponibles las rentabilidades anteriores a esa fecha.

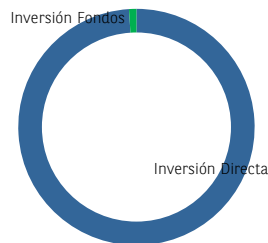
# PROTEA UCITS II NAO PATRIMONIO GLOBAL

## Composición por tipo de activo

Tipo de Activo (fondo vs benchmark)	Fondo	Benchmark
Renta Variable	59,3%	90,0%
Renta Fija	37,9%	0,0%
Tipos de Cambio	7,1%	0,0%
Liquidez	-4,3%	10,0%
<b>TOTAL</b>	<b>100,0%</b>	<b>100,0%</b>



Tipo de Activo (Inv.directa vs fondos)	Inv. Directa	Inv. Fondos
Renta Variable	58,3%	1,0%
Renta Fija	37,9%	-
Tipos de Cambio	7,1%	-
<b>TOTAL</b>	<b>99,0%</b>	<b>1,0%</b>



Fondo: PROTEA UCITS II NAO PATRIMONIO GLOBAL; Benchmark: Euro Stoxx 50; Euribor 12 Month; S&P 500; Bloomberg Barclays Series-E Eu

## 10 Principales posiciones

Instrumento financiero	A. Geográfica	% Patrim
Sandoz Group AG	Suiza	20,5%
EURO FX CURR FUT Jun24	Suiza	7,1%
SB ITGV 3.85% 0.00 15.09.2026	Estados Unidos	4,1%
SB ESGV 2.8% 0.00 31.05.2026	Italia	2,5%
L' Oreal SA	España	2,3%
SB ESGV 0.0% 0.00 31.01.2028	Francia	2,2%
McDonald's Corp	España	2,0%
AstraZeneca PLC	Estados Unidos	1,9%
Assa Abloy AB	Reino Unido	1,6%
Unilever PLC	Suecia	1,6%
<b>TOTAL</b>		<b>45,9%</b>

## Distribución por sectores

Sector	% Patrim
Salud	24,7%
Prod. Primera Necesidad	8,5%
Industrial	6,2%
Prod. Consumo No Básico	5,9%
Finanzas	5,5%
Tecnología Información	4,4%
Serv. Telecom.	1,6%
Química	1,5%

## Distribución por A. Geográfica

A. Geográfica	% Patrim
Suiza	24,1%
Francia	8,9%
Estados Unidos	8,1%
Países Bajos	5,1%
Otros	13,1%

## Distribución por divisa

Divisa	RV	RF	LQ	IA	TOTAL
EUR	22,0%	32,4%	2,0%	0,0%	<b>56,4%</b>
CHF	24,1%	0,0%	0,0%	0,0%	<b>24,1%</b>
USD	8,1%	5,5%	0,5%	0,0%	<b>14,1%</b>
GBP	3,5%	0,0%	0,0%	0,0%	<b>3,5%</b>
SEK	1,6%	0,0%	0,3%	0,0%	<b>1,9%</b>

Fuente Tablas: porcentajes calculados a partir de los datos de NAO.

El fondo mencionado en el presente documento (en adelante el "Fondo") no garantiza que los datos contenidos en este informe (en adelante los "Datos") sean completos, exactos o libres de errores u omisiones. El Fondo no se hace responsable de este informe en ningún caso. Esta comunicación de marketing es distribuida por el Fondo o agencias de distribución autorizadas únicamente con fines informativos y no constituye una oferta para suscribir acciones del Fondo. En cualquier caso, las suscripciones del Fondo, un fondo de inversión sujeto a la normativa de Luxemburgo (SICAV), deben realizarse únicamente en base al folleto actual, el Documento de información clave para el inversor ("KID"), los artículos de constitución y el informe anual o semestral más reciente y después de buscar el asesoramiento de un especialista financiero, legal, contable y fiscal independiente. Los interesados podrán obtener, en inglés, los documentos antes mencionados de forma gratuita en las agencias de distribución autorizadas y en las oficinas del Fondo en 15, avenue John F. Kennedy, L-1855 Luxemburgo.

Puede obtener un resumen de los derechos de los inversores en el siguiente enlace: <https://www.pictet.com/content/dam/www/documents/legal-and-notes/fundpartner-solutions/fps-summary-of-investors-rights.pdf.coredownload.pdf>