

PROTEA FUND NAO SUSTAINABLE EUROPE

AGOSTO DE 2019

Características del fondo

Nombre	Protea Fund NAO Sustainable Europe
Nº Registro CNMV	1546
Categoría CNMV	Renta Variable Euro
Horizonte temporal	5 años
Divisa	EUR
Fecha de registro	18/12/2018
Patrimonio Total (miles)	32.562,35
Índice de referencia (Benchmark)	EUROSTOXX50 NET RETURN
Periodicidad del VL	Diario
Hora límite de introducción de órdenes	Antes de las 14:00h
Entidad Gestora	Nao Asset Management, E.S.G. SGIC, S.A.
Entidad Depositaria	Pictet & Cie (Europe) S.A.
Auditor	Deloitte, S.L.
Enlace web Gestora	http://www.nao-sam.com

Nivel de riesgo¹

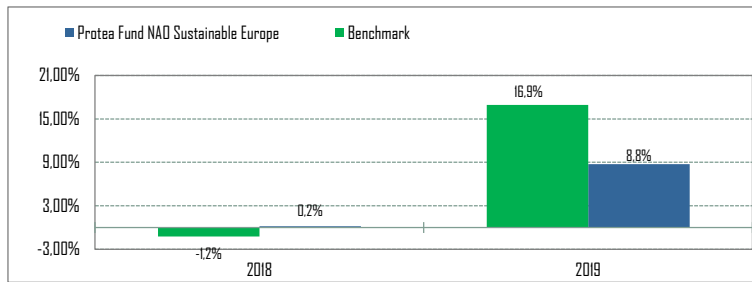
1	2	3	4	5	6	7	
Riesgo menor						Riesgo mayor	

¹ Este indicador se basa en la volatilidad de los precios en los últimos cinco años, y es un indicador de riesgo absoluto. 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 lograr una apreciación del capital sobre el medio y largo plazo, ofrecido a través de una exposición a las acciones de mercado, prestando la debida atención a los aspectos ambientales, sociales y criterios de gobernanza.

Rendimiento anual vs Benchmark

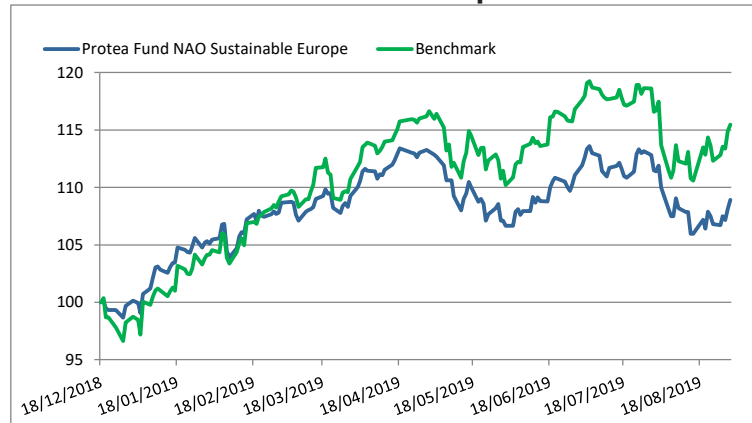


Clases de participaciones

	Discount	Rebate	CLASE Clean
ISIN	LU1904671127	LU1904671556	LU1904671473
Valor Liquidativo	108,93	103,71	101,15
Com. Gestión	0,70%	1,75%	1,00%
Com. Depositario	0,07%	0,07%	0,07%
TER ²	1,02%	2,07%	1,32%
Inversión Mínima	50.000.000 €	-€	-€
Fecha Creación	18/12/2018	22/01/2019	06/06/2019

² 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.

Evolución histórica del valor liquidativo



Estadísticas

Rentabilidades	Estadísticas Rentabilidad / Riesgo		
Total desde Inicio	8,93%	Mayor subida mensual	4,95%
Acumulada año 2019	8,77%	Mayor caída mensual	-5,70%
Último mes	-2,23%	% Meses en positivo	77,78%
3 Últimos meses	1,71%	Volatilidad del Fondo	10,58%
12 Últimos meses	-	Volatilidad del Benchmark	13,93%
3 años (anualizada)	-	Beta	0,66
5 años (anualizada)	-	Correlación	0,87
		R2	0,76
		Alpha	-1,28
		Ratio Sharpe	1,18
		Tracking Error	7,02%
		Ratio Información	-1,19

* El fondo ha empezado a desarrollar su política de inversión actual el 18/12/18 por lo que no están disponibles las rentabilidades anteriores a esa fecha.

Rendimientos mensuales

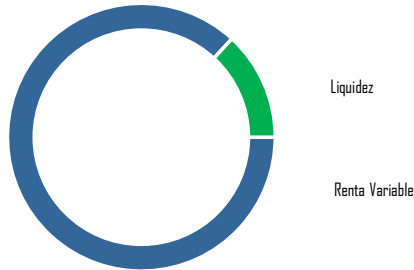
Año	Ene.	Feb.	Mar.	Abr.	May.	Jun.	Jul.	Ago.	Sep.	Oct.	Nov.	Dic.	Annual
2019	5,11%	2,57%	1,33%	3,55%	-5,70%	4,12%	0,32%	-2,23%	-	-	-	-	8,77%
2018	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,15%	0,15%

Datos a 30 de Agosto de 2019

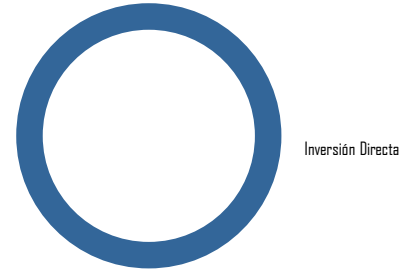
PROTEA FUND NAO SUSTAINABLE EUROPE

Composición por tipo de activo

Tipo de Activo (fondo vs benchmark)	Fondo	Benchmark
Renta Variable	86,8%	100,0%
Liquidez	13,2%	0,0%
TOTAL	100,0%	100,0%



Tipo de Activo (inv.directa vs fondos)	Inv. Directa	Inv. Fondos
Renta Variable	86,8%	-
Liquidez	13,2%	-
TOTAL	100,0%	-



10 Principales posiciones

Instrumento financiero	A. Geográfica	% Patrim
Mayr Melnhof Karton AG	Austria	6,8%
Prysmian SpA	Italia	5,8%
Inditex SA	España	5,0%
Sanofi-Aventis SA	Francia	4,8%
Construcciones y Auxiliar de F	España	4,6%
Engie S.A. (GDF Suez)	Francia	4,2%
Novartis AG	Suiza	4,2%
Henkel AG & Co KGaA	Alemania	4,0%
Michelin	Francia	3,4%
bpost SA	Bélgica	3,3%
TOTAL		46,2%

Distribución por sectores

Sector	% Patrim
Industrial	30,7%
Prod. Consumo No Básico	14,5%
Química	13,5%
Salud	13,2%
Prod. Primera Necesidad	6,2%
Serv. Utilidad Pública	4,4%
Tecnología Información	2,5%
Finanzas	1,8%

Distribución por A. Geográfica

A. Geográfica	% Patrim
Francia	24,0%
España	11,4%
Alemania	11,1%
Suiza	10,7%
Otros	29,7%

Distribución por divisa

Divisa	RV	RF	LQ	IA	TOTAL
EUR	75,6%	0,0%	13,2%	0,0%	88,8%
CHF	10,7%	0,0%	0,0%	0,0%	10,7%
GBP	0,5%	0,0%	0,0%	0,0%	0,5%

Las rentabilidades pasadas no garantizan rentabilidades futuras. El valor de las inversiones y de sus rendimientos pueden variar y el inversor puede no recuperar su inversión original. Este documento es informativo y no supone recomendación u oferta para suscribir participaciones. NAO está inscrita en la CNMV con el número 287.

Antes de toda suscripción o compra se recomienda leer también el folleto más reciente y consultar el último informe financiero publicado. Toda esta información está disponible gratuitamente en el domicilio de la sociedad Gestora NAO ASSET MANAGEMENT, E.S.G., S.G.L.L.C., S.A. (PLAZA AYUNTAMIENTO, 27 PLANTA 7 - 46002 - VALENCIA) o contactando en el teléfono 960 454 015 o en el correo info@nao-sam.com. Asimismo pueden consultarse en la página web www.nao-sam.com, y en la CNMV.