

PROTEA UCITS II NAO PATRIMONIO GLOBAL

JUNIO 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) | 63.589,44 |
| 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. Luxembourg |
| Auditor | Deloitte, S.L. |
| Enlace web Gestora | http://www.nao-sam.com |
| Clasificación Sostenibilidad (SFDR) | Artículo 6 |

Nivel de riesgo¹

| | | | | | | |
|--------------|---|---|--------------|---|---|---|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 |
| Riesgo menor | | | Riesgo mayor | | | |

¹ 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.

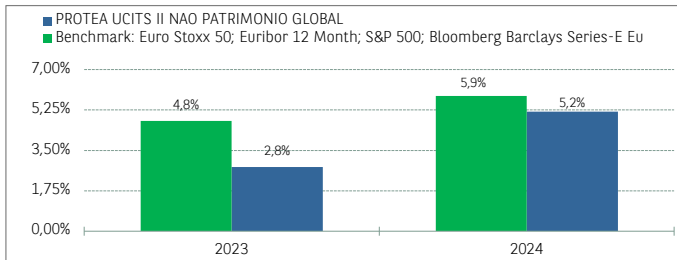
Objetivo

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

Clases de participaciones

| | CLASE A | CLASE B |
|-------------------|--------------|--------------|
| ISIN | LU2471066774 | LU2705726771 |
| Valor Liquidativo | 108,10 | 104,26 |
| Com. Gestión | 0,75% | 1,10% |
| Com. Depositario | 0,07% | 0,07% |
| TER ² | 1,08% | 1,37% |
| Inversión Mínima | - | - |
| Fecha Creación | 14/06/2023 | 23/01/2024 |

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.

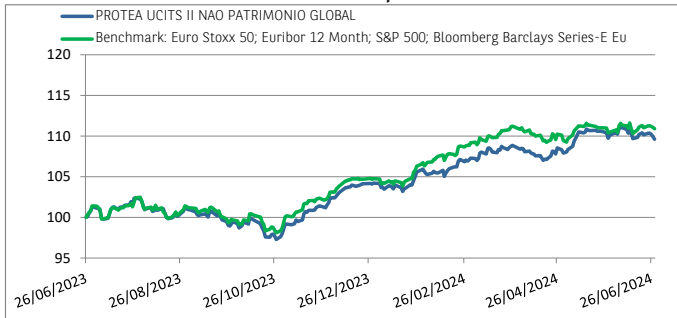
³ Las cifras mostradas no incluyen todos los costes del producto en sí. Para más información, por favor consulte el folleto y otros documentos del fondo.

Estadísticas

| Rentabilidades | | Estadísticas Rentabilidad / Riesgo | |
|---------------------|--------|------------------------------------|--------|
| Total desde inicio | 8,10% | Mayor subida mensual | 3,88% |
| Acumulada año 2024 | 5,18% | Mayor caída mensual | -1,47% |
| Último mes | -0,55% | % Meses en positivo | 53,85% |
| 3 Últimos meses | 1,10% | Volatilidad del Fondo | 5,20% |
| 12 Últimos meses | 8,20% | Volatilidad del Benchmark | 5,24% |
| 3 años (anualizada) | - | Beta | 0,90 |
| 5 años (anualizada) | - | Correlación | 0,91 |
| | | R2 | 0,83 |
| | | Alpha | -0,02 |
| | | Ratio Sharpe | 1,15 |
| | | Tracking Error | 2,20% |
| | | Ratio Información | -0,30 |

* 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.

Evolución histórica del valor liquidativo



Rendimientos mensuales

| Año | Ene. | Feb. | Mar. | Abr. | May. | Jun. | Jul. | Ago. | Sep. | Oct. | Nov. | Dic. | Anual |
|------|-------|-------|-------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|--------|-------|-------|-------|
| 2024 | 1,36% | 1,38% | 1,68% | -0,46% | 2,13% | -0,55% | - | - | - | - | - | - | 5,18% |
| 2023 | - | - | - | - | - | -0,09% | 0,99% | -1,31% | -1,47% | -1,47% | 3,88% | 2,34% | 2,78% |

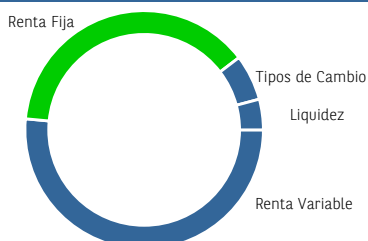
El rendimiento pasado no es una guía del rendimiento futuro. La rentabilidad futura está sujeta a fiscalidad que depende de la situación personal de cada inversor y que puede cambiar en el futuro.

Datos a 28 de Junio de 2024

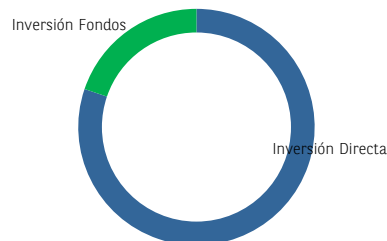
PROTEA UCITS II NAO PATRIMONIO GLOBAL

Composición por tipo de activo

| Tipo de Activo (fondo vs benchmark) | Fondo | Benchmark |
|-------------------------------------|---------------|---------------|
| Renta Variable | 56,1% | 90,0% |
| Renta Fija | 41,6% | 0,0% |
| Tipos de Cambio | 6,8% | 0,0% |
| Liquidez | -4,5% | 10,0% |
| TOTAL | 100,0% | 100,0% |



| Tipo de Activo (Inv.directa vs fondos) | Inv. Directa | Inv. Fondos |
|--|--------------|--------------|
| Renta Variable | 36,4% | 19,8% |
| Renta Fija | 41,6% | - |
| Tipos de Cambio | 6,8% | - |
| TOTAL | 80,2% | 19,8% |



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 |
|---------------------------------|----------------|--------------|
| Protea Fund - NAO Sustainable | Luxemburgo | 19,8% |
| EURO FX CURR FUT Sep24 | Suiza | 6,8% |
| SB ITGV 3.85% 0.00 15.09.2026 | Estados Unidos | 3,9% |
| SB ESGV 2.8% 0.00 31.05.2026 | Italia | 2,3% |
| SB ESGV 0.0% 0.00 31.01.2028 | España | 2,1% |
| Assa Abloy AB | España | 1,7% |
| LVMH Moet Hennessy Louis Vuitt | Suecia | 1,6% |
| SB ROSW 3.312% 0.00 04.12.2027 | Francia | 1,6% |
| Koninklijke Ahold Delhaize NV | Países Bajos | 1,6% |
| ESGV Cupón Cero.00pb 06.12.2024 | Países Bajos | 1,6% |
| TOTAL | | 42,9% |

Distribución por sectores

| Sector | % Patrim |
|-------------------------|----------|
| Prod. Primera Necesidad | 7,7% |
| Tecnología Información | 7,5% |
| Industrial | 5,5% |
| Prod. Consumo No Básico | 4,9% |
| Finanzas | 4,5% |
| Química | 2,9% |
| Salud | 2,7% |
| Serv. Telecom. | 0,6% |

Distribución por A. Geográfica

| A. Geográfica | % Patrim |
|----------------|----------|
| Luxemburgo | 19,8% |
| Estados Unidos | 7,7% |
| Francia | 7,6% |
| Países Bajos | 5,0% |
| Otros | 16,1% |

Distribución por divisa

| Divisa | RV | RF | LQ | IA | TOTAL |
|--------|-------|-------|------|------|--------------|
| EUR | 40,9% | 37,6% | 1,3% | 0,0% | 79,8% |
| USD | 8,4% | 4,0% | 0,7% | 0,0% | 13,1% |
| CHF | 3,9% | 0,0% | 0,0% | 0,0% | 3,9% |
| SEK | 1,7% | 0,0% | 0,3% | 0,0% | 1,9% |
| GBP | 1,2% | 0,0% | 0,0% | 0,0% | 1,2% |

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>