

PROTEA FUND NAO RESPONSIBLE EUROPE

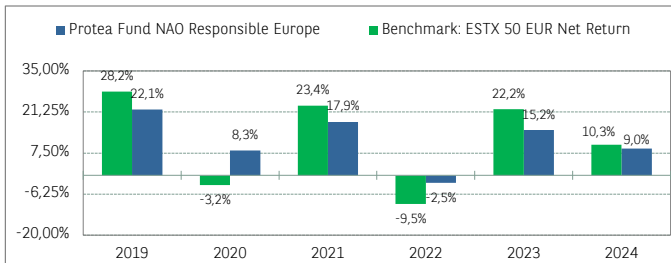
JUNIO DE 2024

Comunicación de Marketing

Características del fondo

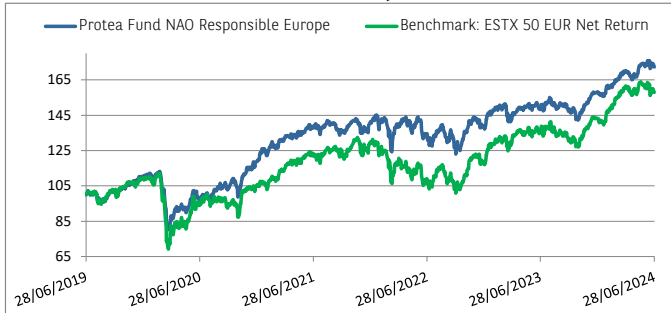
| | |
|--|---|
| Nombre | Protea Fund NAO Responsible Europe |
| Nº Registro CNMV | 1546 |
| Categoría CNMV | Renta Variable Euro |
| Horizonte temporal | 5 años |
| Divisa | EUR |
| Fecha de registro | 18/12/2018 |
| Patrimonio Total (miles) | 64.436,71 |
| Índice de referencia (Benchmark) | EUROSTOXX50 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. 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 8 |

Rendimiento anual vs Benchmark



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

Evolución histórica del valor liquidativo



Fuente: VL del fondo cálculados 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 | 2,12% | 2,23% | 3,16% | -1,34% | 3,96% | -0,62% | - | - | - | - | - | - | 8,97% |
| 2023 | 7,76% | 1,56% | -2,48% | 1,92% | -0,99% | 2,29% | 2,19% | -1,88% | -1,96% | -3,20% | 6,44% | 3,27% | 15,21% |
| 2022 | 0,28% | -3,60% | 1,90% | 2,46% | 0,32% | -8,19% | 4,12% | -3,45% | -4,97% | 8,34% | 5,27% | -3,71% | -2,47% |
| 2021 | 2,36% | 3,26% | 5,52% | -0,19% | 1,91% | 1,86% | 0,18% | 1,34% | -2,84% | 3,90% | -4,54% | 4,34% | 17,95% |
| 2020 | -1,82% | -6,13% | -13,27% | 6,13% | 3,89% | 1,24% | -0,81% | 6,25% | 0,65% | -4,46% | 14,88% | 4,26% | 8,31% |

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.

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 y pueden no constituir una indicación fiable del futuro perfil de riesgo del Fondo.
 - La categoría de riesgo que se muestra no está garantizada y puede cambiar con el tiempo.
 - La categoría más baja, que corresponde al Número 1, no puede considerarse libre de riesgo.
 - El Subfondo no proporciona ninguna garantía de capital ni medidas de protección de activos.

¿Por qué se encuentra este Fondo en esta categoría? La cartera de este Fondo consiste esencialmente en acciones o valores relacionados con la renta variable con un perfil medioambiental, social y de gobernanza adecuado. El objetivo del Fondo es lograr el crecimiento del capital mediante el uso de estrategias de inversión vinculadas a la renta variable. Por lo tanto, el perfil de riesgo/beneficio del Fondo debe corresponder a una categoría de alto riesgo en la escala de riesgo/beneficio.

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.

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

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

Clases de participaciones

| | CLASE Discount | CLASE Rebate | CLASE Clean |
|-------------------|----------------|--------------|--------------|
| ISIN | LU1904671127 | LU1904671556 | LU1904671473 |
| Valor Liquidativo | 191,28 | 173,10 | 175,06 |
| Com. Gestión | 0,70% | 1,75% | 1,00% |
| Com. Depositario | 0,07% | 0,07% | 0,07% |
| TER ² | 1,19% | 2,24% | 1,45% |
| 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.
 - 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.

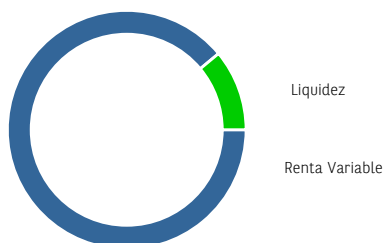
Estadísticas

| Rentabilidades | | Estadísticas Rentabilidad / Riesgo | |
|---------------------|--------|------------------------------------|---------|
| Total desde inicio | 91,28% | Mayor subida mensual | 14,88% |
| Acumulada año 2024 | 8,97% | Mayor caída mensual | -13,27% |
| Último mes | -0,62% | % Meses en positivo | 67,16% |
| 3 Últimos meses | 1,93% | Volatilidad del Fondo | 9,13% |
| 12 Últimos meses | 13,98% | Volatilidad del Benchmark | 12,56% |
| 3 años (anualizada) | 7,72% | Beta | 0,68 |
| 5 años (anualizada) | 11,49% | Correlación | 0,94 |
| | | R2 | 0,89 |
| | | Alpha | 3,46 |
| | | Ratio Sharpe | 1,41 |
| | | Tracking Error | 5,02% |
| | | Ratio Información | -0,18 |

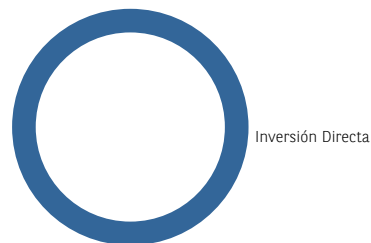
PROTEA FUND NAO RESPONSIBLE EUROPE

Composición por tipo de activo

| Tipo de Activo (fondo vs benchmark) | Fondo | Benchmark |
|-------------------------------------|---------------|---------------|
| Renta Variable | 89,0% | 100,0% |
| Liquidez | 11,0% | 0,0% |
| TOTAL | 100,0% | 100,0% |



| Tipo de Activo (Inv.directa vs fondos) | Inv. Directa | Inv. Fondos |
|--|---------------|-------------|
| Renta Variable | 89,0% | - |
| Liquidez | 11,0% | - |
| TOTAL | 100,0% | - |



Fondo: Protea Fund NAO Responsible Europe; Benchmark: ESTX 50 EUR Net Return

10 Principales posiciones

| Instrumento financiero | A. Geográfica | % Patrim |
|------------------------|----------------|--------------|
| ASML Holding NV | Países Bajos | 5,0% |
| Novartis AG | Suiza | 4,9% |
| Intesa Sanpaolo SpA | Italia | 4,9% |
| Allianz SE | Alemania | 4,4% |
| Inditex SA | España | 4,0% |
| Schneider Electric SA | Francia | 3,9% |
| Microsoft Corp | Estados Unidos | 3,4% |
| Legrand SA | Francia | 3,3% |
| Sika AG | Suiza | 3,2% |
| Unilever PLC | Reino Unido | 3,1% |
| TOTAL | | 40,2% |

Distribución por sectores

| Sector | % Patrim |
|-------------------------|----------|
| Tecnología Información | 16,4% |
| Industrial | 14,4% |
| Finanzas | 14,0% |
| Química | 14,0% |
| Prod. Consumo No Básico | 13,5% |
| Prod. Primera Necesidad | 9,1% |
| Salud | 7,7% |

Distribución por A. Geográfica

| A. Geográfica | % Patrim |
|---------------|----------|
| Francia | 21,0% |
| Suiza | 14,6% |
| Alemania | 10,1% |
| Países Bajos | 9,5% |
| Otros | 33,8% |

Distribución por divisa

| Divisa | RV | RF | LQ | IA | TOTAL |
|--------|-------|------|-------|------|--------------|
| EUR | 59,9% | 0,0% | 11,0% | 0,0% | 70,9% |
| CHF | 14,6% | 0,0% | 0,0% | 0,0% | 14,6% |
| USD | 7,6% | 0,0% | 0,0% | 0,0% | 7,6% |
| GBP | 3,1% | 0,0% | 0,0% | 0,0% | 3,1% |
| Otros | 3,8% | 0,0% | 0,0% | 0,0% | 3,8% |

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

Características que promueve este fondo

El Compartimento tiene como objetivo promover una amplia gama de características ambientales y sociales a las que las inversiones subyacentes pueden estar expuestas. Ejemplos de características ambientales y sociales promovidas por el Compartimento son:

- Medioambiental: Reducción de las emisiones de carbono y de la contaminación del aire; promoción de temas medioambientales a largo plazo, como la protección del medio ambiente, la eficiencia energética y la mejora de la vida; oportunidades en tecnologías limpias y renovables (reciclaje); reducción de residuos (tóxicos) y materiales de embalaje; en menor medida, reducción del estrés hídrico y pérdida de biodiversidad.
- Social: promoción de acciones para desarrollar la diversidad y la inclusión entre los empleados (incluida la igualdad de género); creación de empleo y remuneración justa; desarrollo y bienestar de los empleados más allá de los estándares de Salud y Seguridad.

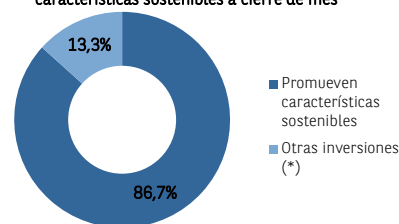
La Gestora de Inversiones pretende promover estas características teniendo en cuenta que, en todo momento, se deben cumplir unas salvaguardas mínimas en términos de prácticas de buen gobierno de la empresa y el respeto a los principios y estándares de comportamiento responsable como la Declaración de Derechos Humanos, Derechos Humanos, la Declaración de la Organización Internacional del Trabajo (OIT), el Pacto Mundial de Derechos Humanos, los Principios Rectores de las Naciones Unidas sobre Empresas y Derechos Humanos y los Objetivos de Desarrollo Sostenible de las Naciones Unidas.

No se ha designado ningún punto de referencia con el fin de alcanzar las características ambientales o sociales promovidas por el Compartimento.

Compromiso

El Fondo se compromete a invertir al menos el 75% de los activos netos del fondo en inversiones que promuevan las características medioambientales y sociales definidas. Sin embargo, no se compromete a realizar ninguna inversión sostenible, ni de carácter ambiental ni social. Tampoco se compromete a realizar ninguna inversión sostenible de acuerdo a la Taxonomía UE.

Distribución Inversiones que promueven características sostenibles a cierre de mes



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