

FT Quant, mešani fleksibilni globalni sklad

Opis sklada

Vzajemni sklad FT Quant je mešani fleksibilni globalni sklad, ki ima lahko v vsakem trenutku do 100 odstotkov sredstev naloženih v lastniške vrednostne papirje, dolžniške vrednostne papirje, instrumente denarnega trga in enote ciljnih skladov, ki nalagajo v navedene finančne instrumente, ter denar in denarne ustreznike, brez osredotočanja na posamezno regijo ali panogo.

Splošni podatki

Družba za upravljanje:	NUMERICA PARTNERJI družba za upravljanje d.o.o.
Začetek poslovanja sklada:	23. 5. 2014
ISIN:	SI0031401589
Velikost sklada (ČVS) (na dan 30. 6. 2017):	1.813.414,74 EUR
Vrednost enote premoženja (VEP) (na dan 30. 6. 2017):	115,3349 EUR
Vstopni stroški:	do 5,00 %
Izstopni stroški:	0,00 %
Celotni stroški poslovanja:	2,65 %

Kumulativna donosnost na 30. 6. 2017

1 dan	1 leto	3 leta	5 let
-0,01 %	13,85 %	15,69 %	-

Sintetični kazalnik tveganj in donosa



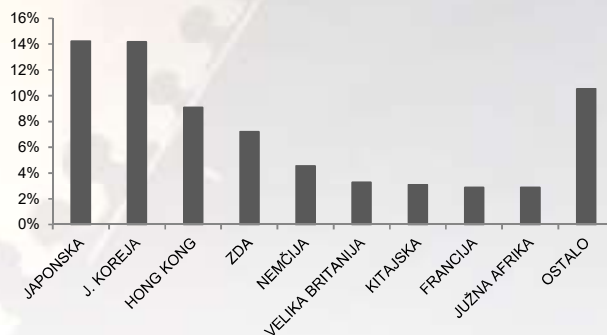
Deset največjih naložb sklada na dan 30. 6. 2017

db x-trackers II iBoxx Global Inflation-Linked ETF	9,92 %
iShares UK Gilts 0-5yr	9,21 %
Peugeot SA	2,89 %
Foot Locker Inc.	2,86 %
LG Display Co Ltd.	2,20 %
SMA Solar Technology AG	2,18 %
Samho International Co Ltd.	2,17 %
Qingling Motors	2,04 %
361 Degrees International	1,95 %
Murray & Roberts Holdings Ltd.	1,93 %

Gibanje vrednosti enote premoženja (v EUR)

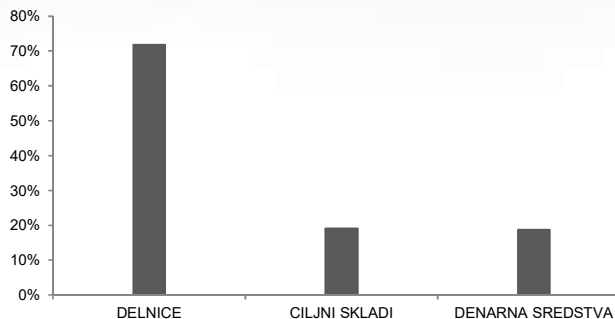


Geografska sestava naložb na dan 30. 6. 2017



* Skladi ETF, ki investirajo v obveznice varnih držav, so izzeti iz prikaza.

Sestava glede na vrsto naložb na dan 30. 6. 2017



Vsebinska, podoba in podatki, objavljeni v tem dokumentu, so pripravljene s strani družbe NUMERICA PARTNERJI družba za upravljanje d.o.o., Dalmatinova 7, 1000 Ljubljana. Poslovanje vzajemnega sklada FT Quant, mešani fleksibilni globalni sklad nadzira Agencija za trg vrednostnih papirjev, Poljanski nasip 6, 1000 Ljubljana. Pretekli donosi naložbe niso pokazatelj uspešnosti v prihodnosti. Prikazani donos naložbe zmanjšujejo vstopni in izstopni stroški: pri samem neto donosu je treba upoštevati vstopno provizijo, izstopnih stroškov pa NUMERICA PARTNERJI družba za upravljanje d.o.o. pri vzajemnem skladu ne zaračunava. Možno je, da vlagatelj ne bo dobil povrnjenega celotnega vloženega zneska. Podatki o tveganosti vzajemnega sklada so navedeni v njegovem prospektu z vključenimi pravili upravljanja in dokumentu s ključnimi podatki za vlagatelje (KIID), ki sta vlagateljem na voljo brezplačno na vseh vpisnih mestih.

Komentar upravljavca

V preteklih mesecih in četrletjih je večina investiranih sredstev šla v pasivne investicije kot so indeksni skladi in ETF-i. Pasivne naložbe sedaj predstavljajo že več kot tretjino celotnega trga in ta trend rasti deleža se še nadaljuje.

Zaradi prilivov v pasivne naložbe in odlivov iz aktivno upravljanih skladov izgleda, kot da so dobre investicijske strategije prenehale delovati. Vsi pomembnejši faktorji (vrednotenja, kakovost poslovanja, momentum, nizka volatilitnost) so v preteklih šestih mesecih imeli podpovprečne donose prav zaradi ogromnih prilivov v indekzne sklade in odlivov iz drugih delov trgov.

Kratkoročno slabši donosi dobrih investicijskih strategij v primerjavi z indeksi so eden izmed glavnih razlogov zakaj te na dolgi rok delujejo tako dobro. Investitorji z dolgoročnim investicijskim horizontom, kot smo tudi mi, se popolnoma zavedajo te cikličnosti strategij in trgov, in so celo v času kratkoročnih slabših rezultatov v primerjavi z indeksi še dodatno pripravljani investirati v te strategije.

V juniju so delniški trgi po svetu končali nižje, indeks MSCI World je, preračunano v EUR, izgubil 1,3 odstotka vrednosti, med tem ko je vrednost enote premoženja sklada končala 0,82 odstotka nižje.

Vsebina, podobe in podatki, objavljeni v tem dokumentu, so pripravljene s strani družbe NUMERICA PARTNERJI družba za upravljanje d.o.o., Dalmatinova 7, 1000 Ljubljana. Poslovanje vzajemnega sklada FT Quant, mešani fleksibilni globalni sklad nadzira Agencija za trg vrednostnih papirjev, Poljanski nasip 6, 1000 Ljubljana. Pretekli donosi naložbe niso pokazatelj uspešnosti v prihodnosti. Prikazani donos naložbe zmanjšujejo vstopni in izstopni stroški: pri samem neto donosu je treba upoštevati vstopno provizijo, izstopnih stroškov pa NUMERICA PARTNERJI družba za upravljanje d.o.o. pri vzajemnem skladu ne zaračunava. Možno je, da vlagatelj ne bo dobil povrnjenega celotnega vloženega zneska. Podatki o tveganosti vzajemnega sklada so navedeni v njegovem prospektu z vključenimi pravili upravljanja in dokumentu s ključnimi podatki za vlagatelje (KIID), ki sta vlagateljem na voljo brezplačno na vseh vpisnih mestih.

Metodologija izračuna podatkov je dostopna na www.numerica-partners.si.