

# WEM High Yield Bonds

K 1. 7. 2023

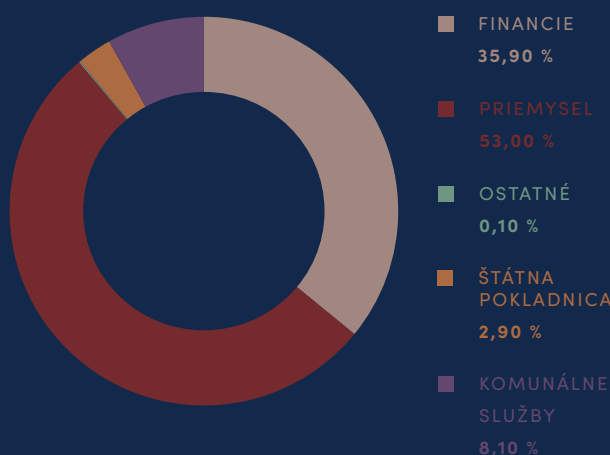
Trieda aktív	Mena	Cieľový výnos	Investičný horizont
Dlhopisy	EUR/USD	> 4 % p.a.	4 roky

## Popis stratégie

Portfólio umožňuje investorom získať expozíciu voči európskym a americkým podnikovým dlhopisom v kvalite BBB alebo nižšej.

Hlavným zdrojom výnosu sú kupóny, ako aj dodatočné výnosy, ktoré investori požadujú za držanie rizikovejších podnikových dlhopisov. V porovnaní s dlhopismi investičného stupňa je táto stratégia navrhnutá tak, aby mala nižšiu citlivosť na úrokové sadzby, ktoré sa pohybujú opačným smerom, ako cena.

## Štruktúra portfólia



## Historická výkonnosť (v EUR)

	1 ROK	3 ROKY	5 ROKOV
WEM High Yield Bonds	5,65 %	8,26 %	16,88 %

## Detaily stratégie – 12 mesiacov

Likvidita	Optimálny vklad	Rizikovosť	Vznik stratégie
Neobmedzená	30 000 EUR	5	1. 6. 2020
Sharpe ratio	Štandardná odchýlka	Kupónový výnos	VaR 95 % (1m)
-0,17	8,08 %	5,87 %	2,72 %

## Výkonnosť portfólia



## Kľúčové benefity

- Nižšia citlivosť na úrokové sadzby
- Diverzifikácia naprieč odvetviami, ratingami a splatnosťami
- Vysoký kupónový výnos

## Kľúčové riziká

- Trhové riziko
- Špecifické riziko spoločnosti
- Menové riziko

Zdroj: Bloomberg Professional Terminal, uvedené údaje zobrazujú historickú výkonnosť. Historická výkonnosť nie je spoľahlivým ukazovateľom budúcej výkonnosti.

Porovnanie simulovanej a historickej výkonnosti portfólia za uvedené obdobie. Výnosy sú prepočítané do meny EUR a sú uvedené pred odrátaním poplatkov, provízií a pred zdanením. Štatistické údaje stratégie sú uvedené za posledných 12 mesiacov.