

WEM Investment Grade Bonds

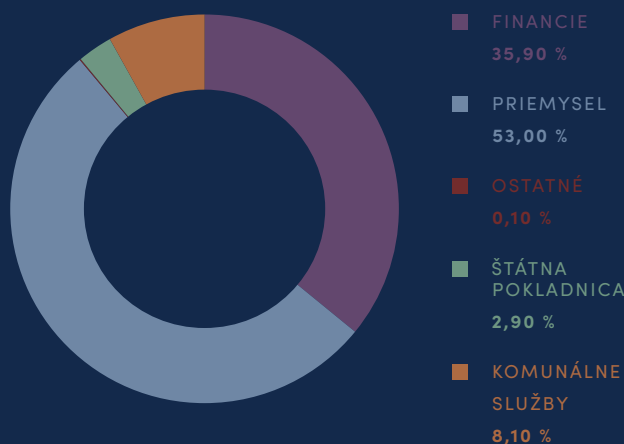
K 1. 7. 2023

| | | | |
|--------------|---------|---------------|---------------------|
| Trieda aktív | Mena | Cieľový výnos | Investičný horizont |
| Dlhopisy | EUR/USD | > 3 % | > 3 roky |

Popis stratégie

Portfólio investuje do amerických firemných dlhopisov s kreditným ratingom vyšším ako BBB od ratingovej agentúry Fitch. Vyšší rating znamená lepšiu solventnosť a nižšiu pravdepodobnosť budúcej neschopnosti splácať. Výnos portfólia sa skladá z kupónového výnosu a zmeny ceny dlhopisu.

Štruktúra portfólia



Simulovaná výkonnosť (v EUR)

| | 1 ROK | 3 ROKY | 5 ROKOV |
|----------------------------|---------|---------|---------|
| WEM Investment Grade Bonds | -2,05 % | -6,66 % | 18,45 % |

Detaily stratégie

| | | | |
|--------------|---------------------|-------------------|-----------------|
| Likvidita | Optimálny vklad | Rizikovosť | Vznik stratégie |
| 100 % | 30 000 EUR | 4 | 1. 6. 2020 |
| Sharpe ratio | Štandardná odchýlka | Dividendový výnos | VaR 95 % (1m) |
| -0,62 | 10,36 % | 3,96 % | 3,89 % |

Výkonnosť portfólia



Kľúčové benefity

- Investície do vysoko kvalitných podnikových dlhopisov
- Diverzifikácia naprieč odvetviami, ratingami a splatnosťami
- Výnos z kupónu

Kľúčové riziká

- Úrokové riziko
- Úverové riziko
- Menové riziko

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

Výnosy sú založené na simulovanej celkovej výnosnosti za uvedené obdobie.