

WEM High Yield Bonds

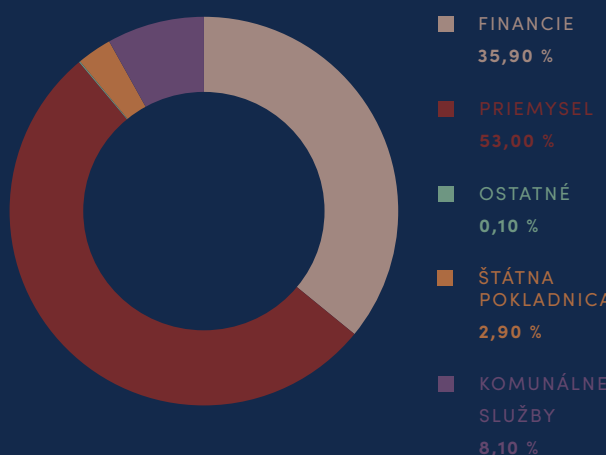
K 28. 6. 2024

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



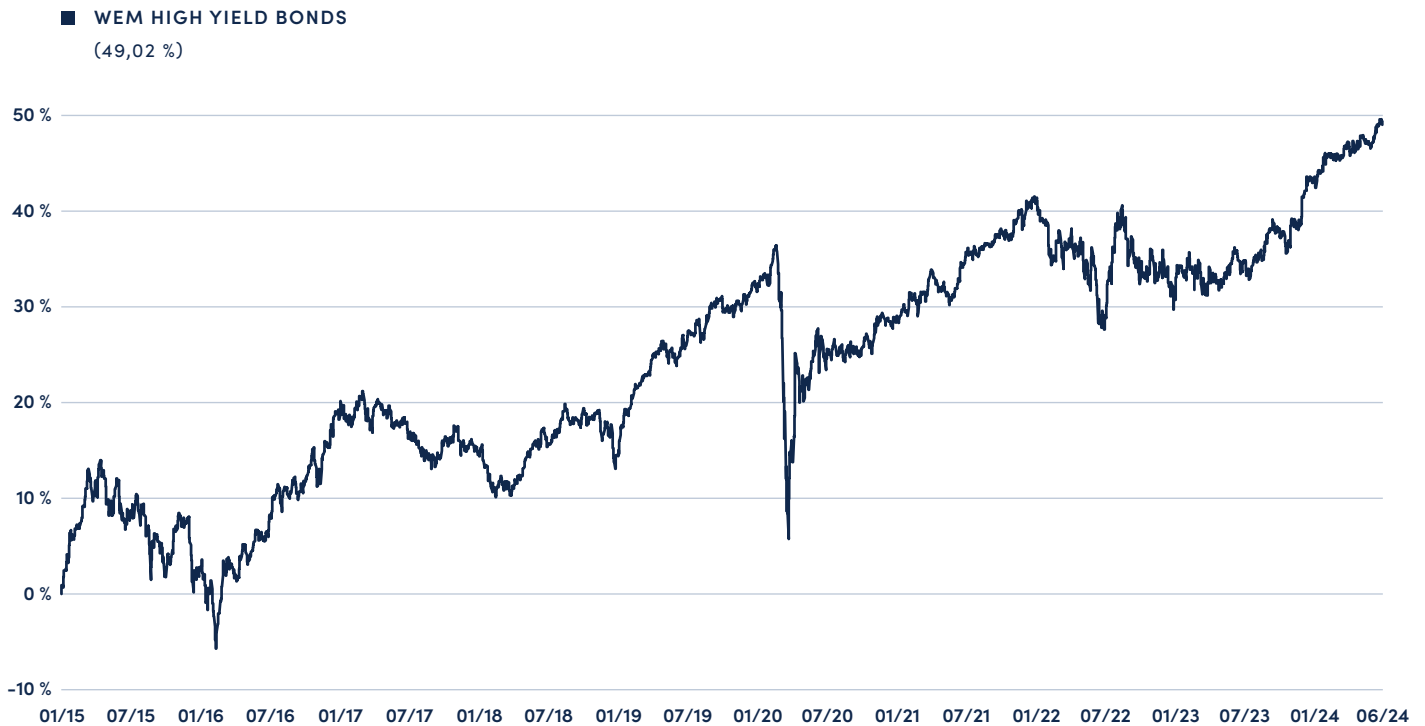
Historická výkonnosť (v EUR)

	1 ROK	3 ROKY	5 ROKOV
WEM High Yield Bonds	11,62 %	10,49 %	18,32 %

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 % (1d)
1,38	5,01 %	6,51 %	0,43 %

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

* Založené na aktuálnej výkonnosti za 12 mesiacov k 28. 6. 2024

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.