

WEM Investment Grade Bonds

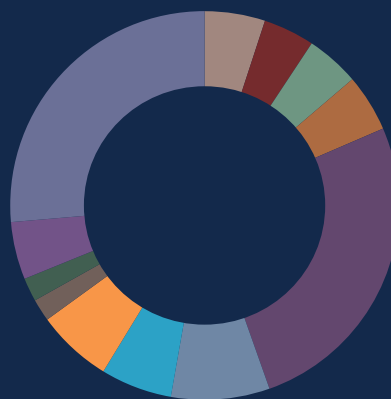
K 28. 6. 2024

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



KOMUNIKAČNÉ SLUŽBY	5,03 %	PRIEMYSEL	5,94 %
TOVARY DLHODOB. SPOT.	4,27 %	INFORMAČNÉ TECHNOL.	6,30 %
SPOTREBNÝ TOVAR	4,45 %	MATERIÁL	1,87 %
ENERGIE	4,78 %	NEHNUTELNOSTI	1,96 %
FINANCIE	26,06 %	KOMUNÁLNE SLUŽBY	4,79 %
ZDRAVOTNÍCTVO	8,20 %	HOTOVOŠŤ A OSTATNÉ	26,37 %

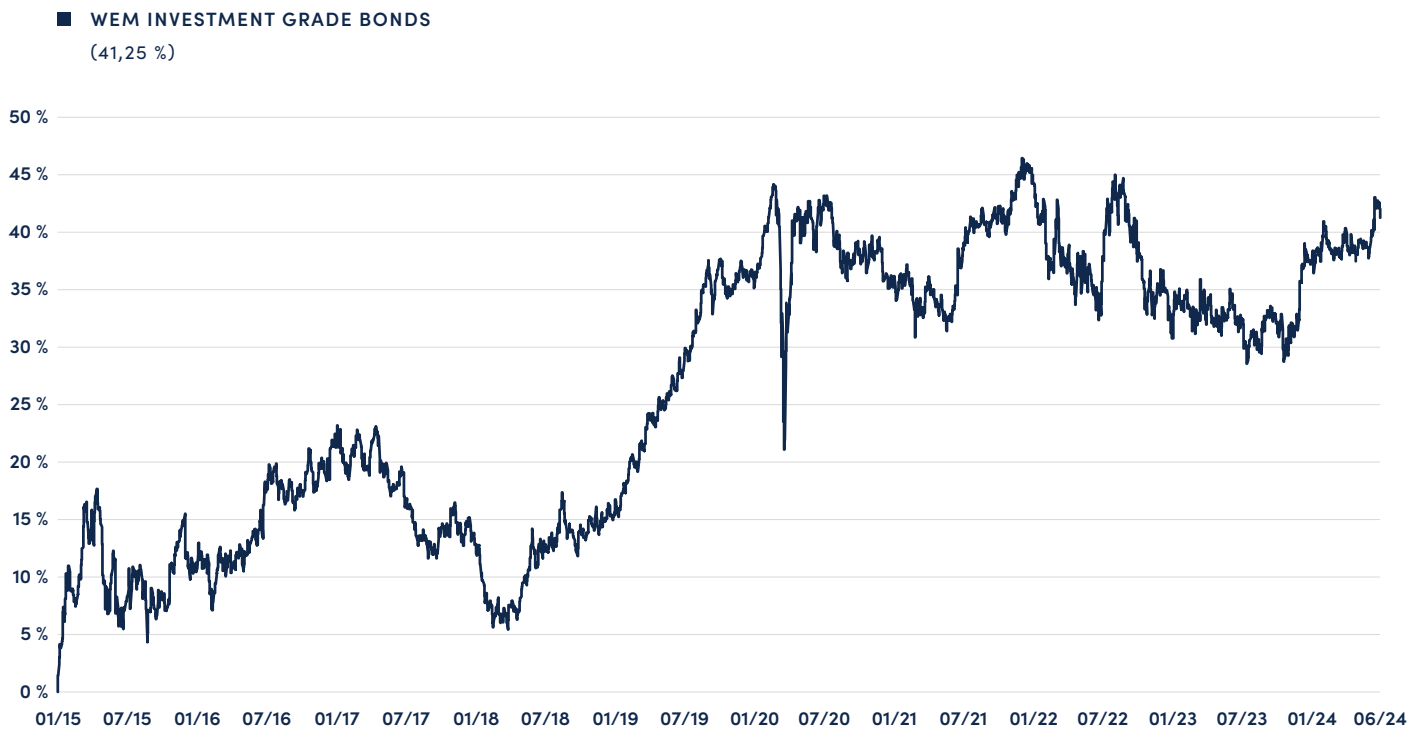
Simulovaná výkonnosť (v EUR)

	(AKTUÁLNA)	3 ROKY	5 ROKOV
WEM Investment Grade Bonds	6,79 %	2,39 %	10,41 %

Detaily stratégie

Likvidita	Optimálny vklad	Rizikovosť	Vznik stratégie
100 %	30 000 EUR	4	1. 6. 2020
Sharpe ratio *	Štandardná odchýlka *	Dividendový výnos *	VaR 95 % (1d)
0,36	7,80 %	4,50 %	0,76 %

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

* 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.

Výnosy sú založené na simulovanej celkovej výnosnosti za uvedené obdobie.