

Detaily stratégie – 12 mesiacov

Likvidita	Optimálny vklad	Rizikovosť	Vznik stratégie
100 %	30 000 EUR	5	1. 6. 2020
Sharpe ratio *	Štandardná odchýlka *	Kupónový výnos *	VaR 95 % (1d)
0,50	8,19 %	5,84 %	0,48 %

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
- Úrokové riziko

* Založené na aktuálnej výkonnosti za 12 mesiacov k 31. 12. 2025

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.