

WEM Balanced

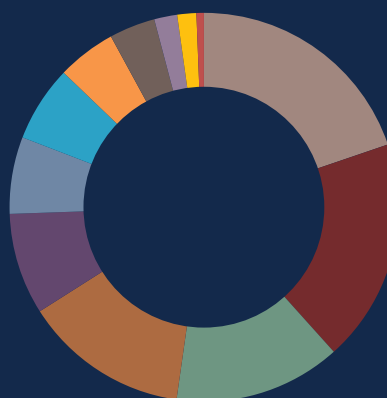
K 31. 12. 2024

Trieda aktív	Mena	Cieľový výnos	Investičný horizont
Zmiešané	EUR/USD	> 5 % p.a.	5+ rokov

Popis stratégie

Stratégia investuje do najväčších amerických spoločností v kombinácii s vysokohodnotenými americkými dlhopismi v investičnom pásme pre dosiahnutie diverzifikácie naprieč triedami aktív a zníženiu celkovej volatility portfólia. Výnos portfólia je tvorený kapitálovým ziskom, ziskom z dividend a kupónov a zmenami vo výmenných kurzoch cudzích mien.

Štruktúra portfólia



FINANCIE	19,76 %	SPOTREBNÝ TOVAR	6,32 %
TECHNOLÓGIE	18,56 %	KOMUNÁLNE SLUŽBY	4,89 %
ZDRAVOTNÍCTVO	13,89 %	ENERGIE	3,82 %
KOMUNIKAČNÉ SLUŽBY	13,74 %	NEHNUTEĽNOSTI	1,91 %
TOVAR DLHODOBEJ SPOTREBY	8,44 %	MATERIÁLY	1,58 %
PRIEMYSEL	6,39 %	NEKLASIFIKOVANÉ	0,62 %

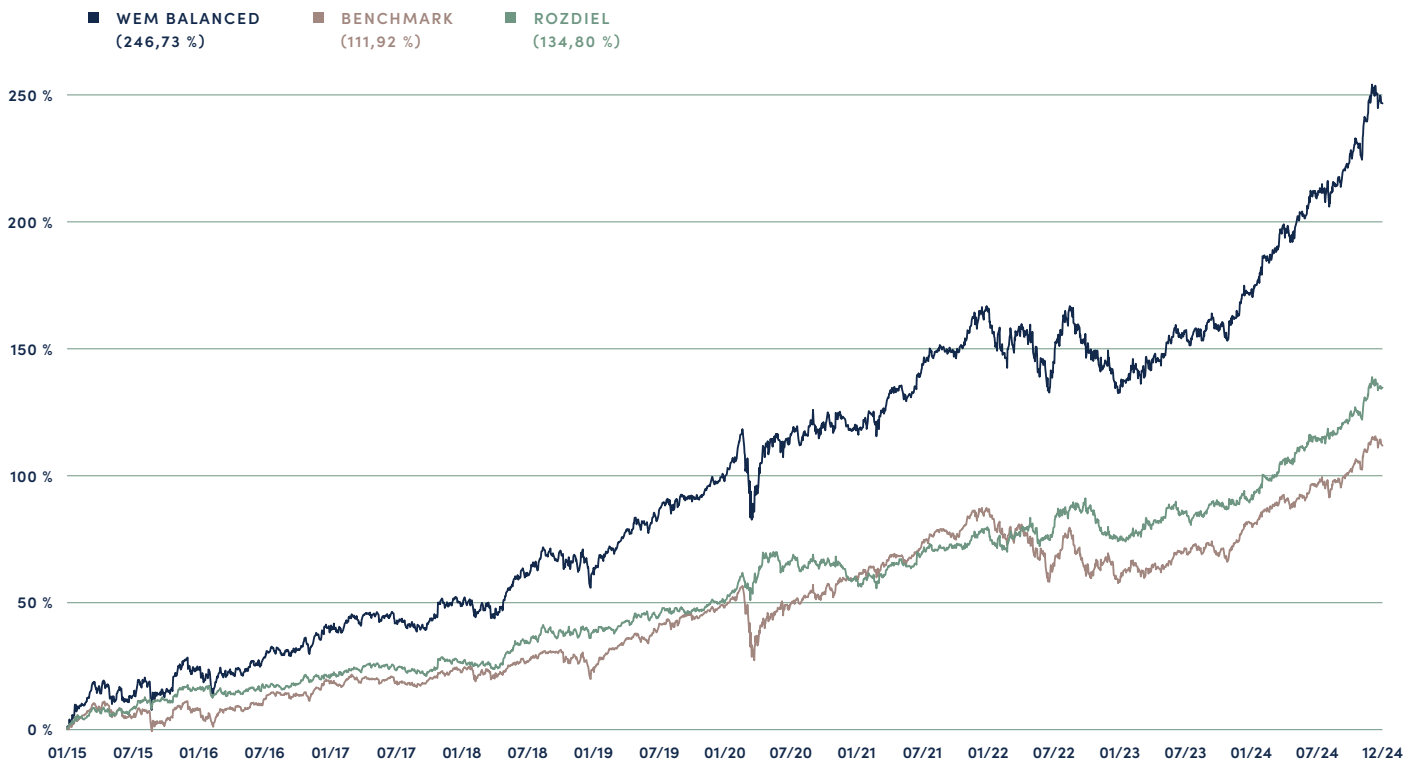
Historická výkonnosť (v EUR)

	1 ROK	3 ROKY	5 ROKOV
WEM Balanced	27,50 %	31,01 %	75,32 %
LEEGTREU 50 % + S&P 500 50 %	16,92 %	14,00 %	43,16 %

Detaily stratégie

Benchmark	Optimálny vklad	Rizikovosť	Vznik stratégie
Syntetický	30 000 EUR	5	1. 3. 2018
Sharpe ratio	Štandardná odchýlka	Beta	VaR 95 % (1d)
2,70	9,01 %	1,07	0,97 %

Výkonnosť portfólia



Kľúčové benefity

- Investícia do najväčších US spoločností a US podnikových a štátnych dlhopisov
- Diverzifikácia naprieč triedami aktív
- Dlhodobý rastový potenciál

Kľúčové riziká

- Trhové riziko
- Špecifické riziko spoločnosti
- Menové riziko
- Úrokové 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.