

WEM Investment Grade Bonds

k 30. 6. 2026

Trieda aktív

Dlhopisy

Mena

EUR/USD

Cieľový výnos

≥ 3 % p.a.

Investičný horizont

3+ rokov



Kontext

Aj spoločnosti s najvyššou úverovou kvalitou si požičiavajú za vyššiu úrokovú sadzbu ako vlády. Táto sadzba sa platí podľa pevného harmonogramu, v hotovosti a nezávisle od situácie na akciových trhoch.



Príležitosť

Túto sadzbu možno inkasovať od dlžníkov s ratingom BBB a vyšším, naprieč dostatočným počtom emitentov na to, aby o výsledku nerozhodli ťažkosti jediného z nich.



Stratégia

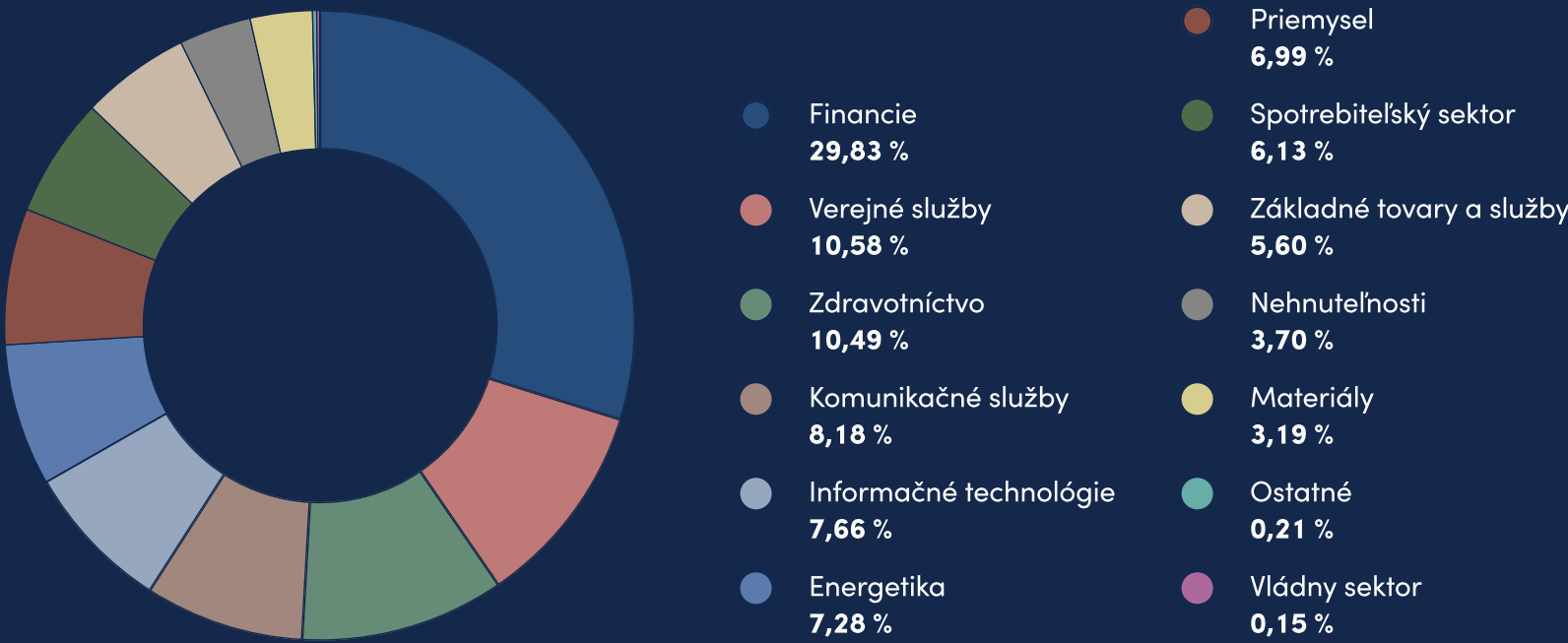
Stratégia investuje do amerických korporátnych dlhopisov s ratingom BBB a vyšším od agentúry Fitch, držaných prostredníctvom ETF. Vyšší rating znamená vyššiu solventnosť a nižšiu pravdepodobnosť oneskorenej alebo nesplatennej platby, hoci nie jej úplné vylúčenie.

Pozície sú rozložené naprieč sektormi, ratingmi a splatnosťami, čo obmedzuje vplyv jednotlivého emitenta aj jednotlivého bodu na výnosovej krivke.

Zdrojom výnosu je kupónový príjem a rast ceny dlhopisov. Výsledky sú vyjadrené v eurách, preto ich ovplyvňujú pohyby kurzu EUR/USD.

Štruktúra portfólia

Sektorové zastúpenie



Historická výkonnosť (v EUR)

1 ROK

3 ROKY

5 ROKOV

WEM Investment Grade Bonds

7,24 %

12,04 %

7,31 %

Likvidita

100 %

Optimálny vklad

30 000 €

Rizikovosť

4

Vznik stratégie

1. 6. 2020

Sharpe ratio

0,85

Štandardná odchýlka *

6,44 %

Dividendový výnos *

4,94 %

VaR 95 % (1d)

0,73 %

Výkonnosť portfólia

■ WEM INVESTMENT GRADE BONDS: 46,67 %



+

Kľúčové benefity

- Investície do vysoko kvalitných podnikových dlhopisov
- Diverzifikácia naprieč odvetviami, ratingami a splatnosťami
- Kupónový výnos

—

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.

* Založené na aktuálnej výkonnosti za 12 mesiacov k 30. 6. 2026.
Výnosy sú založené na simulovanej celkovej výnosnosti za uvedené obdobie.