WEALTH EFFECT MANAGEMENT o.c.p.

Factsheet

WEM *Investment Grade Bonds*

Към 30 юни 2026 г.

Класове активи	Валута	Целева годишна доходност	Инвестиционен хоризонт
Облигации	EUR/USD	≥ 3% p.a.	3+ години

Контекст

Дори компаниите с най-висок кредитен рейтинг заемат средства при по-висока доходност спрямо държавните облигации. Тази премия се изплаща под формата на парични купонни плащания по предварително определен график, независимо от състоянието на фондовите пазари.

Възможност

Тази премия може да се реализира чрез инвестиции в облигации на емитенти с кредитен рейтинг BBB или по-висок, като инвестициите се разпределят между достатъчно на брой емитенти, така че затрудненията на отделен емитент да не определят крайния резултат.

Стратегия

Стратегията инвестира чрез ETF-и в корпоративни облигации на американски емитенти с кредитен рейтинг BBB или по-висок според Fitch. По-високият кредитен рейтинг означава по-добра способност за обслужване на задълженията и по-ниска "вероятност от забавяне" или неизпълнение на плащанията, но не изключва напълно този риск.

Инвестициите са диверсифицирани по сектори, кредитни рейтинги и матуритети, което ограничава влиянието на отделен емитент или на конкретен сегмент от кривата на доходността.

Доходността се формира от купонните плащания и поскъпването на облигациите. Резултатите са изразени в евро, поради което промените във валутния курс EUR/USD също оказват влияние върху тях.

Структура на портфейла

Сектори



Историческо представяне (в евро)

	1 година	3 години	5 години
WEM Investment Grade Bonds	7,24%	12,04%	7,31%

Параметри на *стратегията*

Ликвидност	Оптимална инвестиция	Ниво на риск	Начална дата
100%	30 000€	4	01.06.2020

Коефициент на Шарп *	Стандартно отклонение *	Купонна доходност *	VaR 95% (1d)
0,85	6,44%	4,94%	0,73%

Представяне на *портфейла*



+ Основни предимства

- Инвестиции в корпоративни облигации с висок кредитен рейтинг
- Диверсификация по сектори, кредитен рейтинг и матуритет на облигациите
- Получаване на купонен доход

— Основни рискове

- Лихвен риск
- Кредитен риск
- Валутни рискове

Източник: Bloomberg Professional Terminal. Представените данни се отнасят за минали периоди. Миналата доходност не е надежден показател за бъдещите резултати.

* На база действителната доходност за последните 12 месеца към 30 юни 2026 г.
Резултатите се основават на симулираната обща доходност за посочения период.