

AMUNDI FUND SOLUTIONS - BUY AND WATCH OPTIMAL YIELD BOND 04/2026 - A CZK Hgd

MĚSÍČNÍ
REPORT

31/08/2021

DLUHOPISY ■

Klíčové informace

NAV (kurz fondu) : **1,125.69 (CZK)**
NAV a AUM k datu : **31/08/2021**
Hodnota majetku pod správou (AUM) :
1,277.65 (miliony CZK)
ISIN kód : **LU2092767552**
Benchmark : **Fond nemá benchmark**
Poslední kupón : -

Cíl investičního fondu

Cílem Podfondu je dosáhnout výnosu a jeho sekundárním cílem je dosáhnout zhodnocení kapitálu v průběhu doporučeného období, a to investicemi zejména do dluhů investičního nebo podinvestičního stupně a dluhových nástrojů libovolného typu od široké škály emitentů včetně vlád, nadnárodních subjektů, mezinárodních veřejných orgánů a podniků kdekoli na světě (včetně rozvíjejících se trhů), ale také do nástrojů peněžního trhu a hotovosti.

Investice Podfondu mohou zahrnovat zejména podřízené dluhopisy, prioritní dluhopisy, přednostní cenné papíry a konvertibilní cenné papíry.

Investice Podfondu mohou zahrnovat podmíněně konvertibilní dluhopisy až do 10 % aktiv Podfondu a hybridní obligace společnosti až do 20 % aktiv Podfondu.

Podfond bude usilovat o zajištění měnové expozice z investic do nástrojů, které nejsou denominovány v eurech, zpět k euru.

Datum splatnosti nebo datum výpovědi obligací bude obecně kompatibilní s datem splatnosti Podfondu. Podfond může investovat až 20 % aktiv do vypověditelných obligací s datem splatnosti po datu splatnosti Podfondu za předpokladu, že první datum výpovědi je před datem splatnosti Podfondu.

Podfond může využívat derivátů ke snížení různých rizik, k účinné správě portfolia a jako způsob získání expozice (dlouhodobé či krátkodobé) vůči různým aktivům, trhům, tokům příjmů nebo jiným investičním příležitostem.

Podfond může investovat až 10 % aktiv do jiných SKI nebo SKIPCP.

Cílem Podfondu je dosáhnout do data splatnosti Podfondu široké diverzifikace.

Referenční index: Podfond je řízen aktivně, avšak ne s ohledem na referenční index.

Podfond ve svém investičním procesu zohledňuje udržitelné faktory a hlavní nepříznivé dopady investičních rozhodnutí na ně, jak je blíže specifikováno v prospektu v sekci „udržitelné investice“.

Počáteční období upisování podfondu skončí dne 29. května 2020. Podfond dosáhne splatnosti dne 06. dubna 2026 („Datum splatnosti“), kdy bude Podfond zlikvidován a čistý výnos z likvidace bude rozdělen mezi držitele akcií.

Jde o třídu akcií bez distribuce. Výnos z investic je znovu investován.

Minimální doporučený termín držení je 6 let.

Investoři mohou prodávat na vyžádání v kterýkoli pracovní den v Lucembursku.

Vývoj celkové výkonnosti fondu (základ 100)



Celková výkonnost

Od data	Od začátku roku	1 měsíc	3 měsíce	1 rok	3 roky	5 let	Od založení
Portfolio	31/12/2020	30/07/2021	31/05/2021	31/08/2020	-	-	02/06/2020
Portfolio	2.87%	1.16%	1.24%	8.77%	-	-	12.57%

Roční výkonnost

	2020	2019	2018	2017	2016
Portfolio	-	-	-	-	-

* Zdroj: Amundi. Výkonnost je měřena za celý kalendářní rok – 12 měsíců. Všechny výnosy jsou očištěny od poplatků podfondu (primárně vstupní, výměnné a výstupní poplatky). Minulá výkonnost není zárukou budoucích výnosů. Hodnota investice může fluktuovat nahoru a dolů v závislosti na tržních změnách.

Profil rizika a výnosu (SRRI)



◀ Nižší riziko, potenciálně nižší výnosy

▶ Vyšší riziko, potenciálně vyšší výnosy

Ukazatel SRRI představuje profil rizika a výnosu a je uveden v dokumentu Klíčové informace pro investory (KID). Nejnižší kategorie neznámá, že zde neexistuje žádné riziko.

Statistiky fondu

	Portfolio
Modifikovaná durace ¹	2.63
Průměrný rating	B+
Výnos do splatnosti	3.54%
SPS	11.06%
Rozdíl (spread) ²	409
Počet pozic v portfoliu	162

¹ Modifikovaná durace udává procentuální změnu kurzovních hodnoty při změně výnosnosti o jeden procentní bod

² Rozpětí (spread): rozdíl ve výnosu mezi firemním dluhopisem a jeho referenčním vládním dluhopisem

Analýza rizik

	1 rok	3 roky	5 let
Volatilita portfolia	4.40%	-	-
Sharpeho poměr	1.89	-	-

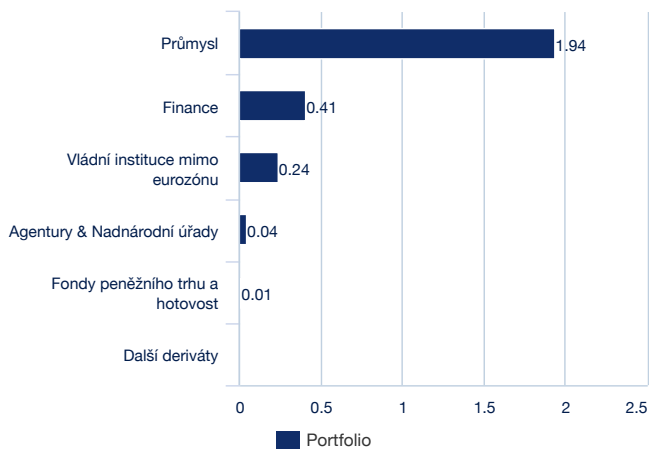
Analýza výkonnosti

	Od založení
Maximální pokles	-2.69%
Doba zotavení (ve dnech)	37
Nejhorší měsíc	09/2020
Nejnižší měsíční výkonnost	-1.38%
Nejlepší měsíc	11/2020
Nejlepší měsíční výkonnost	4.77%

DLUHOPISY ■

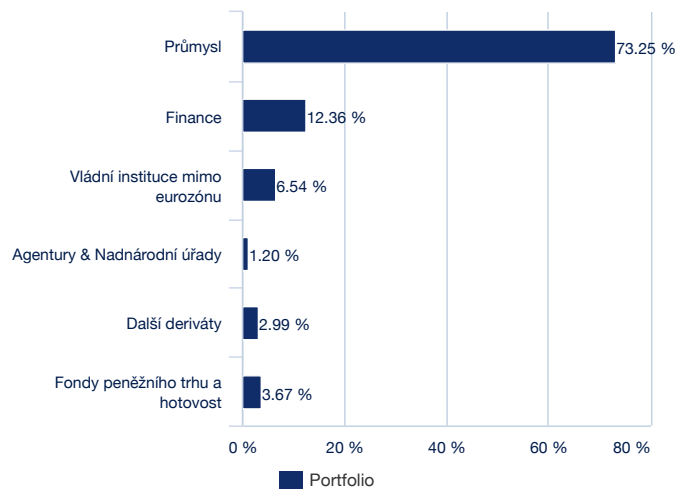
Složení portfolia podle emitenta

Modifikovaná durace



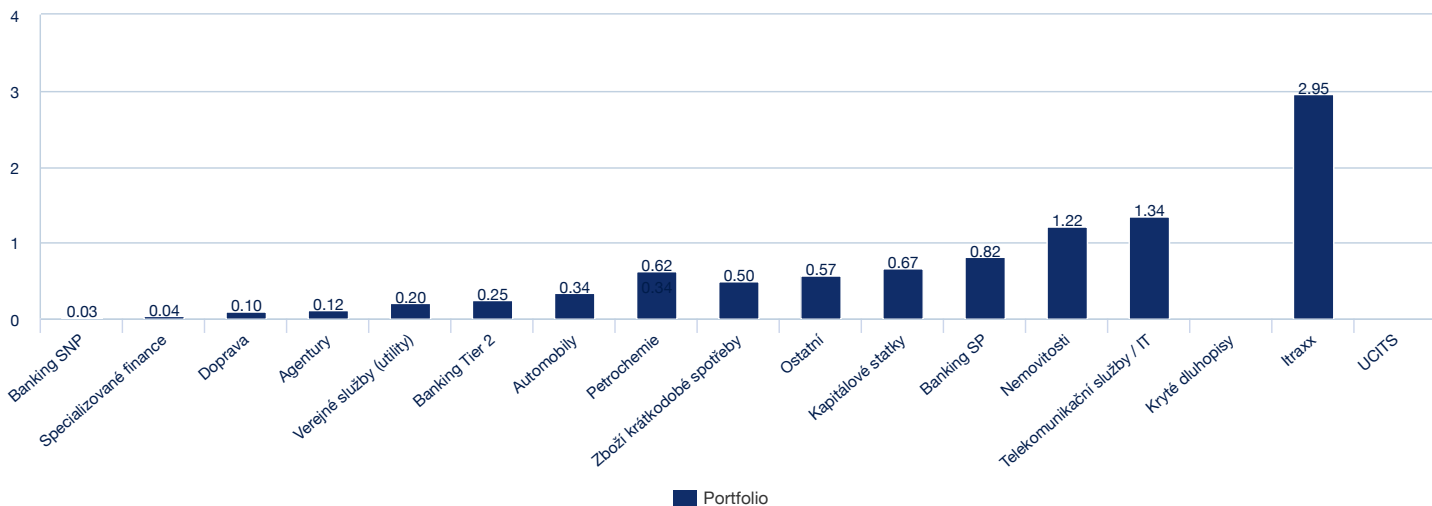
Zahrnuje deriváty

Procentuální zastoupení aktiv *



* Celková hodnota nemusí dávat 100 %, jelikož není započítána odložená hotovost

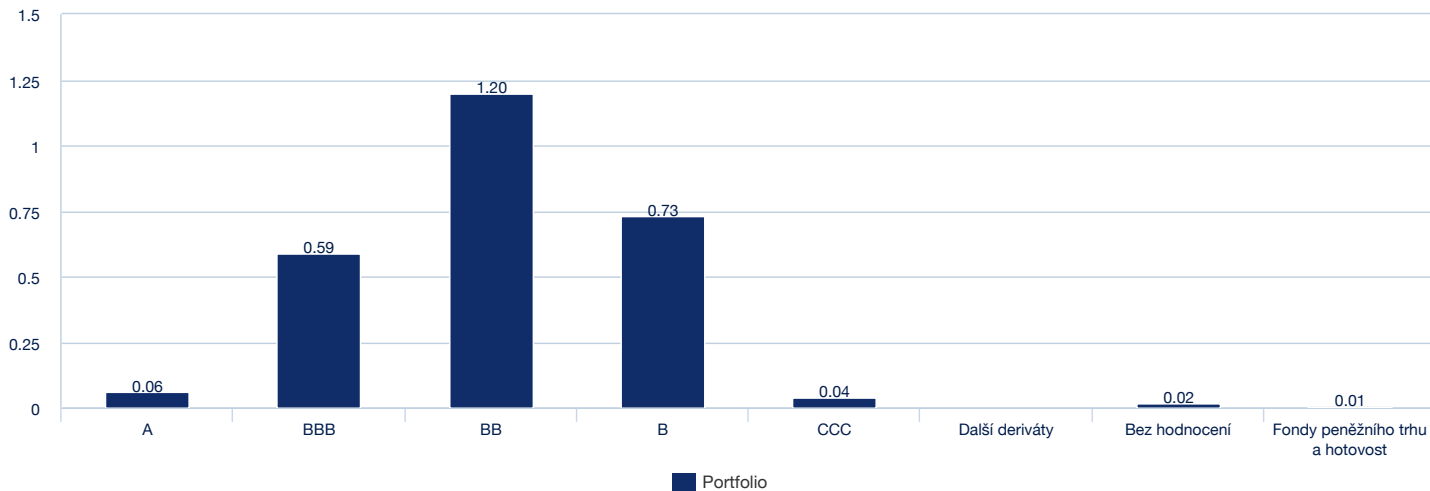
Složení portfolia podle sektorů (modifikovaná durace vážená spready)



DLUHOPISY ■

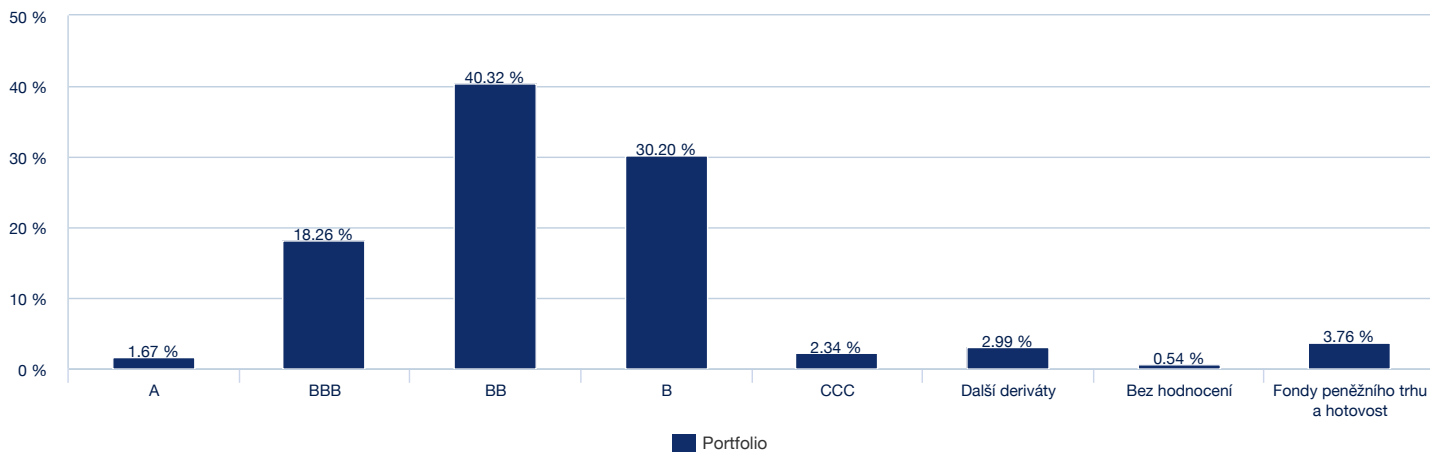
Složení portfolia dle ratingu

Modifikovaná durace



Zahrnuje deriváty

Procentuální zastoupení aktiv *



* Celková hodnota nemusí dávat 100 %, jelikož není započítána odložená hotovost

DLUHOPISY ■

Hlavní emitenti

	BWR Amundi Paris Sect Lb	% aktiv	Modifikovaná durace	BWR SPS Global c. (PTF)	BWR SPS Global c. (REF)
Vláda	-	-	-	-	-
EGYPT	Vládní instituce mimo eurozónu	1.41%	0.05	0.20%	-
TURKEY	Vládní instituce mimo eurozónu	1.19%	0.05	0.20%	-
FEDERAL REPUBLIC OF NIGERIA	Vládní instituce mimo eurozónu	0.89%	0.03	0.12%	-
UKRAINE	Vládní instituce mimo eurozónu	0.74%	0.02	0.11%	-
BAHRAIN (KINGDOM OF)	Vládní instituce mimo eurozónu	0.73%	0.03	0.09%	-
COLOMBIA	Vládní instituce mimo eurozónu	0.47%	0.02	0.03%	-
DOMINICAN REPUBLIC	Vládní instituce mimo eurozónu	0.39%	0.02	0.03%	-
BELARUS (REPUBLIC OF)	Vládní instituce mimo eurozónu	0.38%	0.01	0.10%	-
PAKISTAN	Vládní instituce mimo eurozónu	0.35%	0.01	0.07%	-
Firmy	-	-	-	-	-
THYSSENKRUPP AG	Průmysl	1.12%	0.04	0.09%	-
PETROLEOS MEXICANOS	Průmysl	1.09%	0.04	0.15%	-
TELECOM ITALIA SPA/MILANO	Průmysl	1.07%	0.04	0.09%	-
REPSOL INTL FINANCE BV	Průmysl	1.06%	0.03	0.09%	-
CROWN EUROP HOLDINGS SA	Průmysl	1.06%	0.04	0.07%	-
TURKCELL ILETISIM HIZMETLERI	Průmysl	1.05%	0.04	0.12%	-
ARDAGH PACKG FINCE/A HLG USA	Průmysl	1.04%	0.03	0.08%	-
TEVA PHARMA FIN NLD II BV	Průmysl	1.03%	0.03	0.12%	-
AT&T INC	Průmysl	1.01%	0.03	0.11%	-
RENAULT SA	Průmysl	0.99%	0.04	0.07%	-
VEON HOLDINGS BV	Průmysl	0.98%	0.03	0.06%	-
ALTICE FRANCE SA/FRANCE	Průmysl	0.92%	0.03	0.11%	-
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	Průmysl	0.92%	0.01	0.04%	-
FIBRIA OVERSEAS FINANCE LTD	Průmysl	0.91%	0.03	0.03%	-
IHS NETHERLANDS HOLDCO BV	Průmysl	0.90%	0.00	0.00%	-

DLUHOPISY ■

Základní charakteristika

Složení fondu	SICAV Luxembourgois
Správce fondu	Amundi Luxembourg SA
Depozitář	SOCIETE GENERALE LUXEMBOURG
Datum založení fondu	02/06/2020
Datum spuštění třídy	02/06/2020
Měna fondu	EUR
Referenční měna třídy	CZK
Třída	Akumulační
ISIN kód	LU2092767552
Kód Reuters	LP68610043
Bloomberg kód	AMYB0AC LX
Frekvence výpočtu NAV	Denně
Časová lhůta pro přijetí objednávky	Pokyny přijaté každý den J před 18:00
Maximální vstupní poplatek	2.00%
Výkonnostní poplatek	Žádný
Výstupní poplatek (maximum)	1.00%
Celkové náklady	1.11% (Odhadovaný)
Doporučený investiční horizont	6 let
Historický benchmark	02/06/2020: Fond nemá benchmark
Poplatek za správu	0.90

Právní informace

Tento dokument má pouze informativní charakter, jedná se o zjednodušenou informaci, která nemá smluvní povahu. Hlavní charakteristiky fondů jsou uvedeny v právní dokumentaci, která je k dispozici na webových stránkách AMF nebo na vyžádání v hlavních kancelářích správcovské společnosti. Doba trvání fondu je neomezená. Investoři berou na vědomí následující rizika: Hodnota investice a příjem z ní mohou stoupat i klesat, přičemž není zaručena plná návratnost původně investované částky. Každá osoba, která má zájem investovat do OPCVM, by měla být o těchto rizicích ujištěna před úpisem a měla by být seznámena s právní dokumentací a daňovými důsledky každého OPCVM. Zdrojem dat obsažených v tomto dokumentu je Amundi, není-li uvedeno jinak. Údaje v tomto dokumentu jsou platné k datu měsíční zprávy, pokud není uvedeno jinak.