

AMUNDI FUNDS GLOBAL AGGREGATE BOND - A CZK Hgd

MĚSÍČNÍ
REPORT

31/10/2019

DLUHOPISY

Klíčové informace

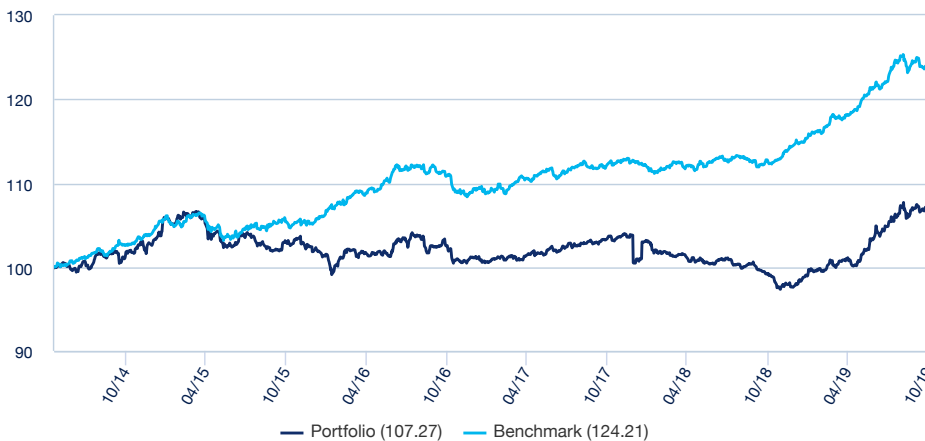
NAV : **2,682.94 (CZK)**
 NAV a AUM k datu : **31/10/2019**
 ISIN kód : **LU1049752758**
 Hodnota majetku pod správou (AUM) :
126,686.77 (miliony CZK)
 Měna fondu : **USD**
 Referenční měna třídy : **CZK**
 Benchmark :
Bloomberg Barclays Global Aggregate index (USD hedged)

Cíl investičního fondu

S cílem dosáhnout kombinace příjmů a kapitálového růstu (celkový výnos). Specificky podfond usiluje o překonání indexu Bloomberg Barclays Global Aggregate Hedged (USD) (po odečtení příslušných poplatků) za doporučenou dobu držení. Podfond investuje nejméně 67 % aktiv do dluhových cenných papírů investičního stupně, které jsou emitovány nebo zaručeny vládami zemí OECD nebo vydány společnostmi. U těchto investic neexistují žádná omezení co do měny. Podfond může investovat až 25 % svých čistých aktiv do čínských dluhových cenných papírů denominovaných v místní měně a investice mohou být provedeny přímo nebo nepřímo (tj. prostřednictvím přístupu Direct CIBM). Expozice podfondu vůči MBS a ABS je omezena na 40 % čistých aktiv. To zahrnuje nepřímou expozici získanou prostřednictvím ohlašovaných cenných papírů (TBA), která je omezena na 20 % čistých aktiv. Podfond investuje nejméně 80 % aktiv do cenných papírů investičního stupně. Podfond využívá derivátů ke snížení různých rizik, k efektivní správě portfolia a jako způsob získání expozice (dlouhé nebo krátké) vůči různým aktivům, trhům nebo jiným investičním příležitostem (včetně derivátů zaměřených na úvěry, úrokové sazby a devizy). Podfond si neklade za cíl kopírovat referenční ukazatel a může se tedy od něj výrazně odchýlovat. Investiční tým pak použije široké spektrum strategických a taktických pozic včetně arbitráže mezi úvěrovou sazbou, úrokovou sazbou a devizovými trhy a sestaví vysoce diverzifikované portfolio.

Výkonnost

Vývoj celkové výkonnosti fondu (základ 100)



Celková výkonnost

Od data	Od začátku roku 31/12/2018	1 měsíc 30/09/2019	3 měsíce 31/07/2019	1 rok 31/10/2018	3 roky 31/10/2016	5 let 31/10/2014	Od založení 21/05/2014
Portfolio	9.69%	0.27%	2.28%	8.08%	4.59%	5.37%	7.27%
Benchmark	8.33%	-0.19%	1.55%	10.43%	12.01%	21.01%	24.21%
Rozdíl (spread)	1.37%	0.46%	0.73%	-2.35%	-7.42%	-15.64%	-16.94%

Roční výkonnost

	2018	2017	2016	2015	2014
Portfolio	-2.66%	-0.64%	-0.71%	-1.00%	-
Benchmark	1.76%	3.04%	3.95%	1.02%	-
Rozdíl (spread)	-4.42%	-3.67%	-4.66%	-2.02%	-

*Zdroj: Amundi. Výkonnost je měřena za celý kalendářní rok – 12 měsíců. Všechny výnosy jsou očištěny od poplatků podfondu. 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.

Základní charakteristika

Složení fondu : **SICAV**
 Datum založení fondu : **30/10/2007**
 Datum spuštění třídy : **01/04/2014**
 Oprávněnost : -
 Třída : **Akumulační**
 Minimální investice :
1 tisícina podílového listu / 1 tisícina podílového listu
 Maximální vstupní poplatek : **4.50%**
 Celkové náklady fondu (TER) :
1.05% (Odhadovaný 01/06/2019)
 Výstupní poplatek (maximum) : **0.00%**
 Doporučený investiční horizont : **3 roky**
 Výkonnostní poplatek : **Ano**

Analýza rizik

	1 rok	3 roky	5 let
Volatilita portfolia	3.34%	3.46%	3.58%
Volatilita benchmarku	2.85%	2.52%	2.66%

Volatilita označuje míru kolísání hodnoty aktiva kolem jeho průměrné hodnoty (obvykle jako směrodatnou odchylku těchto změn během určitého časového úseku). Například denní změny na trhu v rozsahu +/- 1,5% odpovídají roční volatilitě ve výši 25%.

DLUHOPISY ■

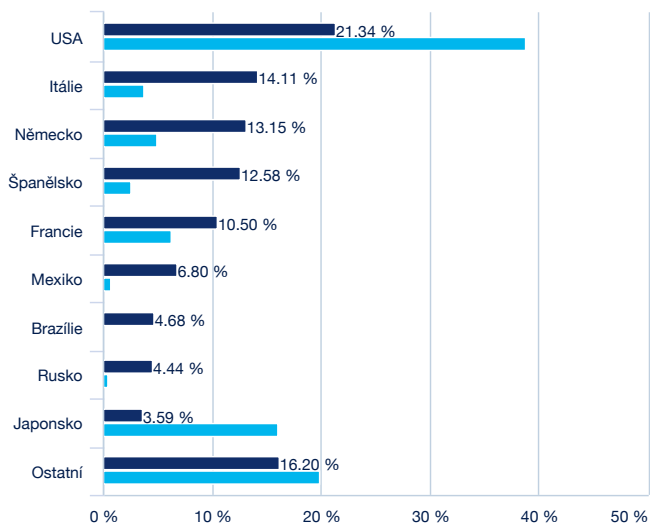


Laurent Crosnier

Chief Investment Officer Amundi
London

Složení portfolia podle zemí

Procentuální zastoupení aktiv *



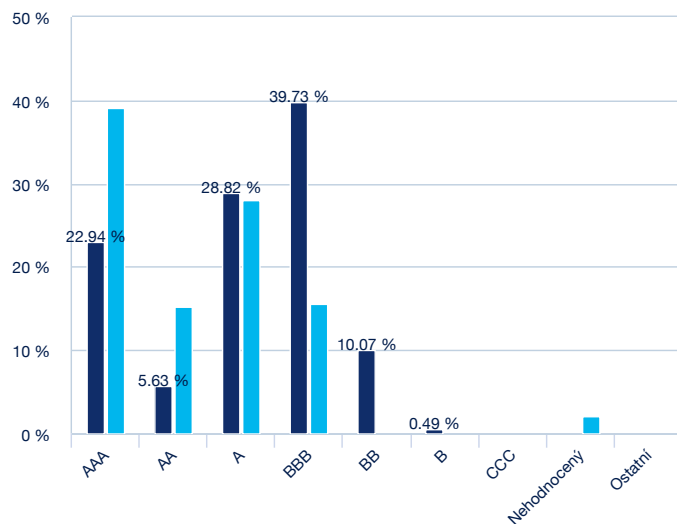
* Z 0 % 10 % 20 % 30 % 40 % 50 %

Statistiky fondu

	Portfolio	Benchmark
Výnos	4.67%	2.06%
Modifikovaná durace ¹	6.41	7.13
Průměrný rating ³	A-	AA-

¹ Modifikovaná durace udává procentuální změnu kurzovní hodnoty při změně výnosnosti o jeden procentní bod³ Zahrnuje dluhopisy a CDS, nezahrnuje jiné typy derivátů. Rating je vypočten jako střední hodnota (median) hodnocení tří ratingových agentur Fitch, Moody's a Standard & Poor's.

Složení portfolia dle ratingu *



* Z

Top 10

UNITED STATES OF AMERICA	12.18%
GERMANY	10.46%
ITALIAN REPUBLIC	10.01%
SPAIN (KINGDOM OF)	8.89%
FRANCE	4.79%
UNITED MEXICAN STATES	4.27%
RUSSIA	3.87%
JAPAN	2.96%
BRAZIL	2.74%
PETROLEOS MEXICANOS (PEMEX)	2.53%

DLUHOPISY ■

Právní informace

Tento dokument slouží výhradně k informativním účelům a nemůže být v žádném okamžiku vnímán jako investiční doporučení, nabídka, investiční poradenství nebo výzva k nákupu nebo prodeji investičních instrumentů včetně akcií nebo podílových jednotek SICAV nebo UCITS fondů (dále jen „UCITS“) ani nesmí být takto interpretován. Tento dokument nepředstavuje základ pro smlouvu ani jiný závazek; byl připraven z zdrojů, které Amundi považuje za spolehlivé. Všechny informace v tomto dokumentu mohou být změněny bez předchozího upozornění. Amundi nepřebírá žádnou odpovědnost za žádnou ztrátu, ať už přímou či nepřímou, která by vyplývala s použitím jakýchkoli informací obsažených v tomto dokumentu. Amundi nemůže být považována za odpovědnou za žádné okolnosti za žádné rozhodnutí založené na těchto informacích. Údaje obsažené v tomto dokumentu jsou přísně důvěrná a nesmí být bez předchozího souhlasu ze strany Amundi kopírována, reprodukována, měněna, překládána nebo distribuována žádné třetí osobě nebo v rámci státu, kde by takováto distribuce nebo použití představovaly porušení právních nebo regulatorních ustanovení nebo kde by byla vyžadována registrace Amundi nebo jejích fondů u příslušných dohledových orgánů. Všechny UCITS nejsou automaticky registrovány v každé zemi nebo vůči celému okruhu investorů. Investování s sebou nese následující rizika: minulá výkonnost UCITS uvedená v tomto dokumentu stejně jako jakékoli simulace založené na minulé výkonnosti nejsou spolehlivým ukazatelem budoucí výkonnosti. Budoucí výkonnost nesmí být predikována na základě minulé výkonnosti. Hodnota investičních instrumentů včetně UCITS podléhá tržním výkyvům; jakákoli investice se může zhodnocovat nebo znehodnocovat. Investoři do UCITS jsou vystaveni rizikům ztráty části nebo všech investovaných finančních prostředků. Každá osoba, která zvažuje investici do UCITS by se měla před samotnou investicí ujistit, že zamýšlená investice je v souladu s relevantní legislativou, jakož i z pohledu daňových pravidel, a měli by se seznámit se všemi platnými dokumenty vztahující se k jednotlivému UCITS. Statut nebo prospekt francouzských UCITS licencovaných ze strany Financial Market Authority (AMF) jsou bezplatně k dispozici na žádost adresovanou do sídla obhospodařující společnosti. Zdrojem informací uvedených v tomto dokumentu je Amundi, není-li uvedeno jinak. Aktuálnost informací uvedených v tomto dokumentu vyplývá z měsíčního reportu (MONTHLY REPORT), není-li uvedeno jinak.