

# AMUNDI FUND SOLUTIONS - BUY AND WATCH HIGH INCOME BOND 11/2024 - A - CZKH

MĚSÍČNÍ  
REPORT

31/12/2020

DLUHOPISY ■

## Klíčové informace

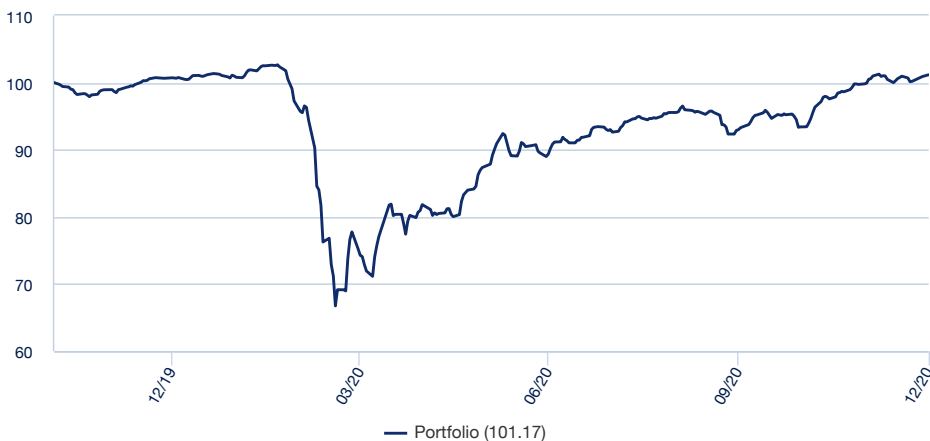
NAV (kurz fondu) : **1,011.68 ( CZK )**  
NAV a AUM k datu : **31/12/2020**  
Hodnota majetku pod správou (AUM) :  
**2,129.47 ( miliony CZK )**  
ISIN kód : **LU2033258356**  
Bloomberg kód : **ABWACZC LX**  
Benchmark : **Fond nemá benchmark**

## Cíl investičního fondu

Hlavním cílem tohoto Podfondu je dosáhnout výnosu a sekundárním cílem Podfondu je dosáhnout zhodnocení kapitálu v průběhu doporučeného období držení investicemi zejména do diverzifikovaného portfolia podnikových dluhů a dluhových nástrojů nebo do dluhů a dluhových nástrojů vydaných jakoukoli vládou, nadnárodními orgány, místními orgány nebo mezinárodními veřejnými orgány, do nástrojů peněžního trhu a hotovosti denominované v eurech, GBP a USD. Podfond bude usilovat o zajištění měnové expozice z investic do nástrojů, které nejsou denominovány v eurech, zpět k euru. Podfond může investovat až 50 % aktiv do rozvíjejících se trhů. 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 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 a k efektivní správě portfolia a jako způsob získání expozice vůči různým aktivům, trhům nebo jiným tokům příjmů. Podfond může také investovat až 10 % aktiv do jiných SKI nebo SKIPCP. Investoři by si měli být vědomi zvýšených rizik investování do rozvíjejících se trhů a do cenných papírů podinvestičního stupně.

## Výkonnost

### Vývoj celkové výkonnosti fondu (základ 100)



### 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.

Úroveň rizika tohoto podfondu primárně odráží tržní riziko mezinárodních investičních vztahů v kontextu předdefinované úrovně pružnosti.

### Celková výkonnost

Od data	Od začátku roku 31/12/2019	1 měsíc 30/11/2020	3 měsíce 30/09/2020	1 rok 31/12/2019	3 roky	5 let	Od založení 04/11/2019
Portfolio	0.44%	1.36%	8.80%	0.44%	-	-	1.17%

### Roční výkonnost

	2020	2019	2018	2017	2016
Portfolio	0.44%	-	-	-	-

\* 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.

## DLUHOPISY ■

## Statistiky fondu

	Portfolio
Modifikovaná durace <sup>1</sup>	2.47
Průměrný rating	BB+
Výnos do splatnosti	4.00%
SPS <sup>2</sup>	44.90%
Rozdíl (spread) <sup>3</sup>	243
Celkový počet titulů v portfoliu	117
Yield to worst	2.24%
Efektivní durace	2.52

<sup>2</sup> SWMD (modifikovaná durace- vážená spready)<sup>1</sup> Modifikovaná durace udává procentuální změnu kurzovní hodnoty při změně výnosnosti o jeden procentní bod<sup>3</sup> Rozpětí (spread): rozdíl ve výnosu mezi firemním dluhopisem a jeho referenčním vládním dluhopisem

## Analýza rizik

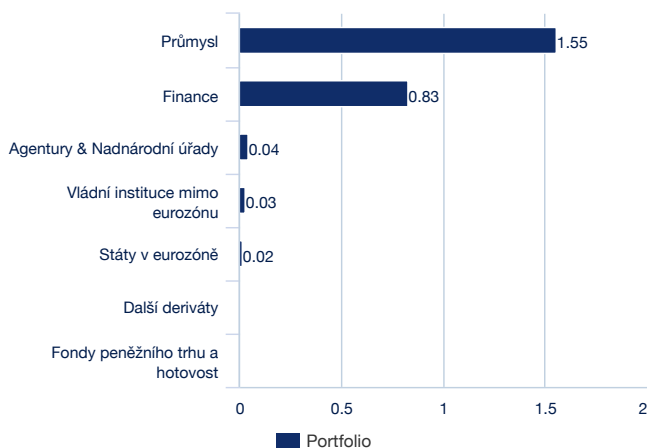
	1 rok	3 roky	5 let
Volatilita portfolia	30.17%	-	-
Sharpeho poměr	-0.05	-	-

## Analýza výkonnosti

	Od založení
Maximální pokles	-34.99%
Nejhorší měsíc	03/2020
Nejnižší měsíční výkonnost	-23.65%
Nejlepší měsíc	04/2020
Nejlepší měsíční výkonnost	10.17%

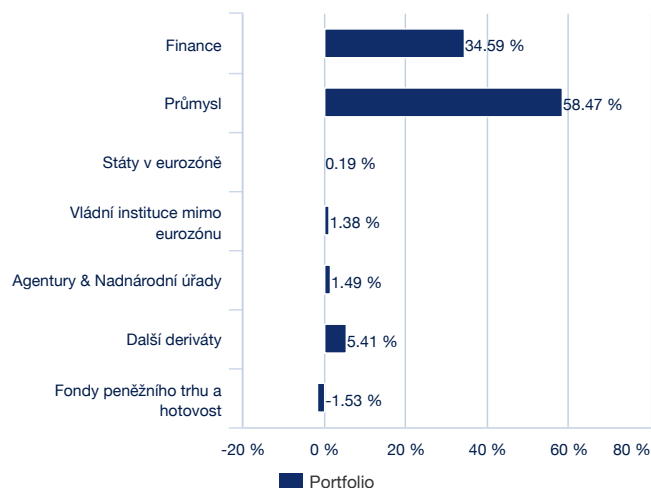
## Složení portfolia podle emitenta

## Modifikovaná durace



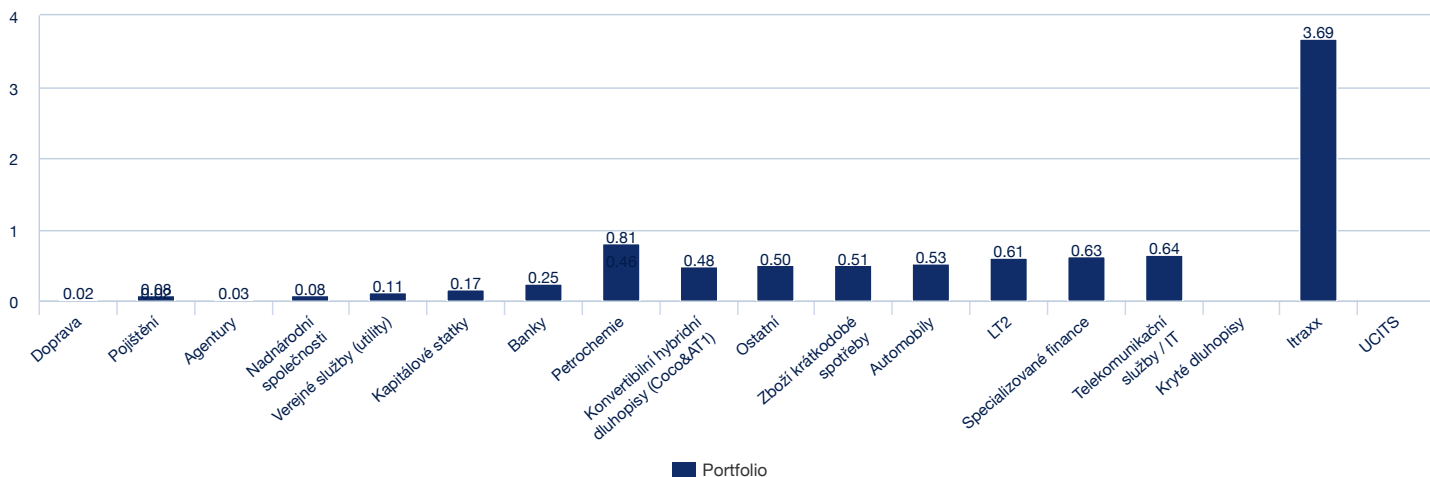
Zahrnuje deriváty

## Procentuální zastoupení aktiv \*



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

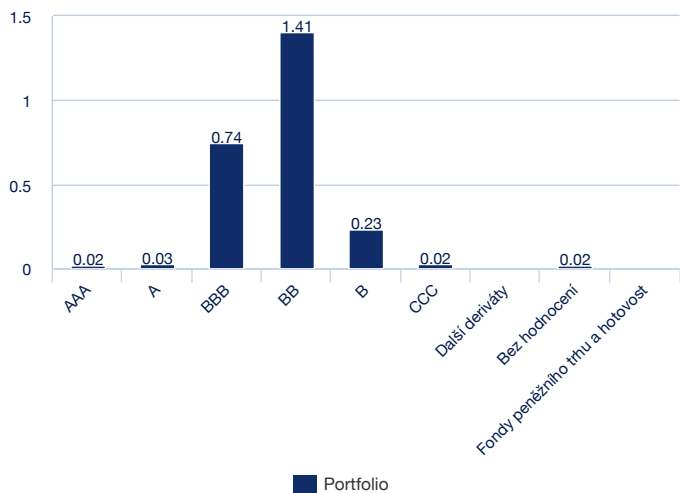
## Složení portfolia podle sektorů (modifikovaná durace vážená spready)



DLUHOPISY ■

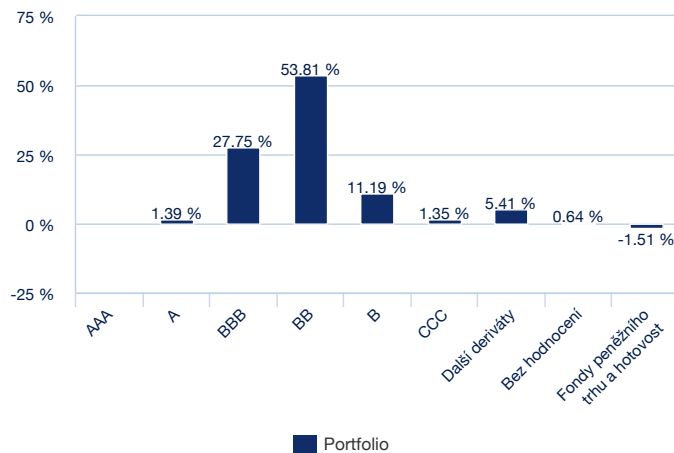
Složení portfolia dle ratingu

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)
<b>Vláda</b>	-	-	-	-	-
SULTANATE OF OMAN	Vládní instituce mimo eurozónu	1.38%	0.03	0.09%	-
<b>Firmy</b>	-	-	-	-	-
DEUTSCHE PFANDBRIEFBK AG	Finance	2.00%	0.03	0.06%	-
PETROLEOS MEXICANOS	Průmysl	1.98%	0.06	0.22%	-
ONEMAIN FINANCE CORP	Finance	1.79%	0.04	0.09%	-
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	Průmysl	1.70%	0.02	0.05%	-
COMMERZBANK AG	Finance	1.69%	0.04	0.06%	-
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO IN	Průmysl	1.68%	0.05	0.04%	-
SCHAEFFLER AG	Průmysl	1.54%	0.04	0.07%	-
NE PROPERTY BV	Finance	1.53%	0.03	0.05%	-
TELECOM ITALIA SPA/MILANO	Průmysl	1.47%	0.04	0.08%	-
RENAULT SA	Průmysl	1.47%	0.05	0.10%	-
ZF EUROPE FINANCE BV	Průmysl	1.47%	0.04	0.09%	-
CROWN EUROP HOLDINGS SA	Průmysl	1.40%	0.04	0.08%	-
BHARTI AIRTEL INTL NDL BV	Průmysl	1.30%	0.04	0.07%	-
BANCO DO BRASIL (CAYMAN)	Finance	1.30%	0.04	0.08%	-
NATWEST GROUP PLC	Finance	1.28%	0.04	0.05%	-

## DLUHOPISY ■

## Základní charakteristika

Zařazení fondu	SICAV Luxembourgois
Správce fondu	Amundi Luxembourg SA
Depozitář	SOCIETE GENERALE LUXEMBOURG
Datum založení fondu	04/11/2019
Datum spuštění třídy	04/11/2019
Měna fondu	EUR
Referenční měna třídy	CZK
Třída	Akumulační
ISIN kód	LU2033258356
Bloomberg kód	ABWACZC LX
Frekvence výpočtu NAV	Denně
Časová lhůta pro přijetí objednávky	Pokyny přijaté každý den J před 18:00
Maximální vstupní poplatek	2.50%
Výkonnostní poplatek	Žádný
Výstupní poplatek (maximum)	1.00%
Celkové náklady	1.10% (Odhadovaný)
Doporučený investiční horizont	5 let
Historický benchmark	01/11/2019: 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.