

NN (L)

Euromix Bond

★
Overall Morningstar Rating™

Morningstar Ratings 30/09/2020

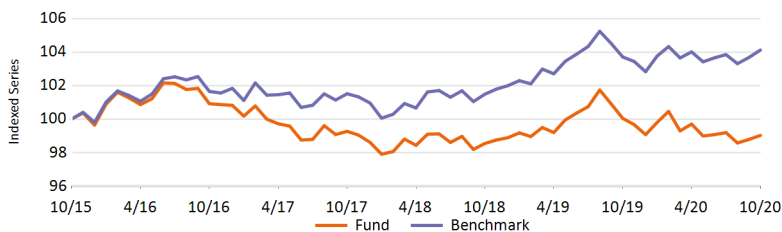
★★
3-year Morningstar Rating™

★
5-year Morningstar Rating™

Investiční politika

Fond investuje především do portfolia státních dluhopisů vysoké kvality (s ratingem AAA až AA-) denominovaných v eurech, převážně dluhopisů, jejichž splatnost je kratší než 10 let. Fond používá aktivní správu k předvídaní změn úrovně výnosů státních dluhopisů v eurozóně, výnosové křivky a rozpětí zemí v rámci eurozóny na základě fundamentální a kvantitativní analýzy. Pozice fondu se proto může významně odchýlit od referenční hodnoty. V horizontu několika let se snažíme překonat výkonost srovnávacího indexu Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Treasury AAA 1-10Y Referenční hodnota široce odráží dluhopisové prostředí s ratingem v investicích denominovaného v eurech, v nejvyšší ratingové kategorii (AAA) a se splatností kratší než 10 let. Pro účely řízení rizik jsou mezní hodnoty dluhopisů a odchylek od země udržovány ve vztahu k referenční hodnotě. Akcie fondu můžete prodat každý (pracovní) den, kdy se také vypočítává jejich aktuální hodnota. Cílem fondu není výplata dividend. Veškeré zisky dále investuje.

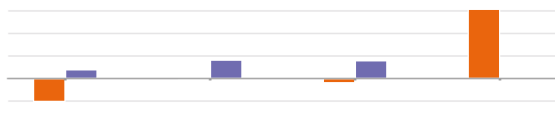
Čistá výkonnost



Čistá kumulativní výkonnost (%)

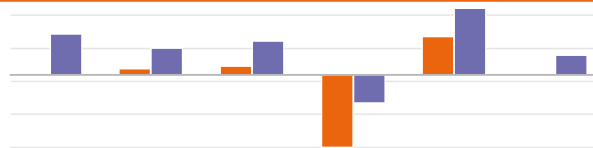
| EUR | 1M | 3M | 6M | 1Y | 3Y | 5Y | Since Inception |
|-------------|------|-------|-------|-------|-------|-------|-----------------|
| ● Fond | 0.24 | -0.17 | -0.68 | -1.02 | -0.24 | -0.97 | 105.42 |
| ● Benchmark | 0.43 | 0.27 | 0.11 | 0.40 | 2.57 | 4.12 | - |

Čistá roční výkonnost (%)



| EUR | 1Y | 3Y | 5Y | Since Inception |
|-------------|-------|-------|-------|-----------------|
| ● Fond | -1.02 | -0.08 | -0.20 | 3.09 |
| ● Benchmark | 0.40 | 0.85 | 0.81 | - |

Čistá výkonnost v kalendářním roce (%)



| EUR | 2020YTD | 2019 | 2018 | 2017 | 2016 | 2015 |
|-------------|---------|------|------|-------|------|------|
| ● Fond | -0.05 | 0.19 | 0.28 | -2.19 | 1.18 | 0.03 |
| ● Benchmark | 1.26 | 0.82 | 1.03 | -0.86 | 2.03 | 0.61 |

Údaje k 31/10/2020

Základní údaje

| | |
|------------------------------|---|
| Typ fondu | FIXED INCOME |
| Třída fondu | P kapitalizační |
| Měna třídy fondu | EUR |
| Kód ISIN | LU0546916619 |
| Kód Bloomberg | IEGBSPE LX |
| Kód Reuters | LU0546916619.LUF |
| Kód Telekurs | 11554564 |
| Kód WKN | A1H9TW |
| Kód Sedol | - |
| Domicil | LUX |
| Benchmark | Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Treasury AAA 1-10Y [J.P. Morgan Government Bond (GBI) Global Euro |
| Frekvence výpočtu ceny (NAV) | Daily |

Informace o fondu

| | |
|---|------------|
| Datum založení fondu | 29/04/2011 |
| Datum založení třídy fondu | 02/05/2011 |
| Čistá hodnota aktiv (NAV) | EUR 172.88 |
| Čistá hodnota aktiv na konci minulého měsíce | EUR 172.46 |
| Nejvyšší cena (NAV) za uplynulý rok (09/03/2020) | EUR 177.50 |
| Nejnižší cena (NAV) za uplynulý rok (19/03/2020) | EUR 170.91 |
| Celkový čistý objem aktiv fondu (mln.) | EUR 292.10 |
| Celková čistá hodnota aktiv na třídu fondu (mln.) | EUR 9.26 |
| Celková čistá hodnota investic (mln.) | EUR 290.34 |
| Počet vydaných podílových listů | 53,545 |
| Durace | 5.33 |
| Průměrný úvěrový rating | AAA |
| Výnos do splatnosti | -0.80 |
| Výnos do nejhoršího data splatnosti | -0.83 |

Poplatky

| | |
|---|-------|
| Poplatky hrazené z majetku fondu v průběhu roku (průběžný poplatek) | 0.85% |
| Roční poplatek za správu | 0.65% |
| Fixní servisní poplatky | 0.15% |

10 největších pozic

| | |
|--|-------|
| GERMANY (FEDERAL REPUBLIC OF) RegS 1.500% 2023-02-15 | 7.29% |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND RegS 0.500% 2028-02-15 | 6.39% |
| DEUTSCHLAND I/L BOND RegS 0.500% 2030-04-15 | 5.65% |
| BUNDESREPUB DEUTSCHLAND RegS 0.500% 2025-02-15 | 5.06% |
| GERMANY (FEDERAL REPUBLIC OF) RegS 6.500% 2027-07-04 | 4.53% |
| GERMANY (FEDERAL REPUBLIC OF) RegS 1.750% 2022-07-04 | 4.18% |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND RegS 0.250% 2027-02-15 | 3.81% |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND RegS 0.500% 2026-02-15 | 3.41% |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND RegS 1.000% 2025-08-15 | 3.06% |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND RegS 0.000% 2026-08-15 | 2.98% |

Právní upozornění

Věnujte prosím pozornost právnímu upozornění na konci dokumentu.

NN (L)

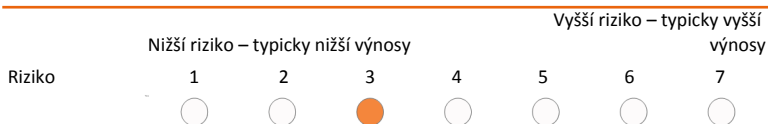
Euromix Bond

Ukazatele

| EUR | 1 rok | 3 roky | 5 let |
|----------------------------------|-------|--------|-------|
| Čistý roční výnos portfolia | -1.02 | -0.08 | -0.20 |
| Volatilita (směrodatná odchylka) | 1.98 | 1.91 | 1.95 |
| Sharpe ratio | -0.21 | 0.27 | 0.14 |
| Alfa | -1.45 | -0.94 | -1.00 |
| α (%) | -1.42 | -0.93 | -1.01 |
| Koeficient Beta | 1.10 | 1.02 | 1.00 |
| Koeficient determinace | 0.94 | 0.95 | 0.95 |
| Information ratio | -2.78 | -2.15 | -2.25 |
| Tracking error | 0.51 | 0.43 | 0.45 |

Rizikový profil

SRRI

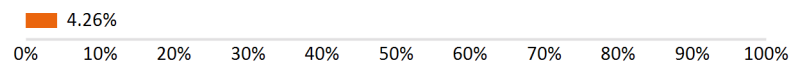


Historická data, která jsou použita pro výpočet rizikového ukazatele, nemusejí být spolehlivým vodítkem budoucího rizikového profilu fondu. Není zaručeno, že tento rizikový ukazatel se nebude v průběhu času měnit. Nejnižší kategorie rizika neznamena, že investice je bez rizika.

Tento fond patří do kategorie 3, protože tržní riziko spojené s Dluhopisy používanými k dosažení investičních cílů je považováno za Střední.

Na tyto finanční nástroje mají vliv různé faktory. K těmto faktorům patří (nikoliv však výlučně) vývoj na finančních trzích a také vývoj ekonomické situace emitentů těchto nástrojů, kteří jsou sami ovlivňováni celkovou situací globální ekonomiky a politickými podmínkami, které panují v každé zemi. Očekávané kreditní riziko podkladových investic, riziko selhání emitentů, je nízké. Likviditní riziko fondu je stanoveno jako nízké. Likviditní rizika vznikají tam, kde je obtížné prodat určitou podkladovou investici, což může způsobit potenciální těžkosti při odkupu vaší investice z fondu. Kromě toho mohou mít na výkonnost fondu vliv pohyby kurzů měn. Investice do specifické geografické oblasti jsou více koncentrovány než investice do různých geografických oblastí. Nelze poskytnout žádnou záruku ohledně návratnosti vaší počáteční investice.

Value at Risk na 95 % úrovni spolehlivosti



VaR (Value at Risk) je statistický ukazatel měřící maximální možnou roční ztrátu, která se může při dané míře pravděpodobnosti vyskytnout.

Údaje k 31/10/2020

Regionální rozdělení

| | |
|---------------------|--------|
| Německo | 83.43% |
| Nizozemí | 20.80% |
| Hotovost | 2.69% |
| Syntetická Hotovost | -6.92% |

Měnové složení

| | |
|-----|---------|
| EUR | 100.00% |
|-----|---------|

Sektorová rozložení

| | |
|---------------------|---------|
| Pokladny | 104.23% |
| Hotovost | 2.69% |
| Syntetická Hotovost | -6.92% |

Složení podle ratingu

| | |
|------|--------|
| AAA | 97.31% |
| Cash | 2.69% |

Ostatní třídy fondu

| | |
|-----------------|--------------|
| X kapitalizační | LU0546916882 |
| V kapitalizační | LU0577845638 |
| N kapitalizační | LU0800560285 |
| I kapitalizační | LU0555024123 |
| P růstová | LU0555024040 |
| R Distribuční | LU1687285228 |
| R Kapitalizační | LU1687285145 |

Akciový fond

Dluhopisový fond

Smlíšený fond

Strukturovaný produkt

Fond peněžního trhu

Právní upozornění

Věnujte prosím pozornost právnímu upozornění na konci dokumentu.

NN (L)

Euromix Bond

Právní upozornění

1. Tento dokument má výhradně propagační charakter a veškerá v něm obsažená stanoviska nelze chápat jako nabídky, rady, ani doporučení ke koupi či prodeji investičních produktů, ani k podílení se na podobných transakcích. Informace obsažené v tomto materiálu nelze považovat ani za finanční či právní rady. Důvěra v informace obsažené v tomto materiálu je výhradním rizikem čtenáře a zcela závisí na jeho úsudku.

2. Fondy Luxembourg zmiňované v tomto dokumentu jsou podřízeným fondem investiční společnosti s variabilním kapitálem (SICAV), založené v Lucembursku. Společnosti SICAV získaly v Lucembursku veškerá nezbytná povolení ze strany Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF). Podřízený fond i SICAV jsou zapsány u CSSF.

3. Veškeré hodnoty výkonnosti, které nejsou uvedeny v měně fondu, byly přepočteny na základě směnného kurzu. Výkonnost se vypočítává na základě čisté hodnoty aktiv na jednotku: NAV-NAV (s vyloučením veškerých vstupních poplatků; s reinvesticí realizovaných kapitálových zisků z cenných papírů), s reinvesticí výnosů. Pokud Fond investuje v zahraničí, jeho hodnota může vlivem směnných kurzů zahraničních měn kolísat. Průběžné poplatky jsou součtem veškerých provizí a nákladů průběžně srážených z průměrné hodnoty aktiv fondu (provozní výdaje). Jejich hodnota je vyjádřena jako procento aktiv fondu. Není-li uvedeno jinak, nejsou žádné údaje auditovány.

4. Investice s sebou přináší rizika, mezi která může patřit i riziko kapitálových ztrát. Věnujte, prosím, pozornost skutečnosti, že výše uvedená výkonnost je historickou skutečností a hodnota vašich investic může stoupat nebo klesat, a dále též skutečnosti, že dřívější výkonnost nezaručuje aktuální ani budoucí výkonnost. Dřívější výkonnost není ve vztahu k budoucím výsledkům jakkoli indikativní a v žádném případě ji za takovou nelze považovat. Cena Jednotek a veškeré výnosy z Jednotek mohou klesat, stejně jako stoupat, a nejsou garantovány. Investoři nemusí získat zpět plnou výši původně investované částky. Volatilita devizových kurzů představuje dodatečné riziko, související se směnnými kurzy. Investoři by neměli svá investiční rozhodnutí činit na základě tohoto dokumentu. Před uskutečněním investice si prostudujte prospekt. Hodnota vašich investic částečně závisí na vývoji na finančních trzích. S každým fondem navíc souvisí specifická rizika. Rizika a náklady specifické pro konkrétní fond jsou popsány v příslušném prospektu. Přesnější informace o investičním fondu, jeho nákladech a rizicích s ním spojených, najdete v příslušném prospektu, Klíčových informacích pro investory (KIID) a příslušných dodatcích. Tyto dokumenty spolu s výroční zprávou a společenskou smlouvou produktu/-ů se sídlem v Lucembursku jsou na vyžádání zdarma k dispozici na www.nnip.com.

5. Jelikož produkt nemusí být v oblasti výkonu soudní pravomoci vašich soudů schválen nebo může být omezeno jeho nabízení, odpovídá za úplné splnění a dodržování veškerých platných zákonů a nařízení v příslušné jurisdikci každý čtenář. Podíly ve Fondu nebyly registrovány v souladu se Zákonem o cenných papírech, platným v USA od roku 1933, ani dle zákonů žádného ze států USA, a fond nebyl registrován v souladu se Zákonem o investičních společnostech, platným v USA od roku 1940. Podíly ve Fondu nelze nabízet, ani přímo či nepřímo prodávat ve Spojených státech nebo jménem nebo ve prospěch jakékoli osoby ze Spojených států, s výjimkou případů, povolených na základě udělené výjimky, nebo v rámci transakce, nepodléhající platné legislativě Spojených států o cenných papírech.

6. Tento dokument byl sestaven s náležitou pozorností a pečlivostí. Přestože byla obsahu tohoto dokumentu věnována mimořádná pozornost, nelze na jeho přesnost, správnost ani úplnost poskytnout žádné garance, záruky, ani v souvislosti s nimi činit jakákoli závazná prohlášení. Veškeré informace uvedené v tomto dokumentu podléhají možnosti změny nebo aktualizace bez předchozího upozornění. Pro aktualizaci informací, prosím, zašlete společnosti NN Investment Partners e-mail na adresu info@nnip.com nebo navštivte stránky www.nnip.com. NN Investment Partners ani žádná jiná společnost nebo jednotka, náležící do skupiny NN Group, ani její představitelé, vedoucí pracovníci, ani zaměstnanci nenesou přímou ani nepřímou odpovědnost v souvislosti s informacemi a/nebo doporučeními jakéhokoli druhu, vyjádřenými v tomto dokumentu, ani za ně nijak neručí. Z informací uvedených v tomto dokumentu nelze vyvozovat žádná práva.

7. Nepřijímáme žádnou přímou ani nepřímou odpovědnost za škody utrpěné čtenáři nebo těmto čtenářům vzniklé na základě používání tohoto dokumentu, nebo v důsledku rozhodnutí, učiněných na základě tohoto dokumentu. Tuto prezentaci ani informace v ní obsažené není bez předchozího písemného svolení v žádné době povoleno kopírovat, reprodukovat, šířit, ani poskytovat jakýmkoli osobám. Veškeré nároky vzniklé z nebo v souvislosti s všeobecnými podmínkami tohoto zřeknutí se odpovědnosti se řídí českým právem.

Poznámka pod čarou

Je zobrazeno 10 nejlepších pozic, s výjimkou hotovosti a syntetické hotovosti. Alokace portfolia (jsou-li k dispozici) jsou uvedeny včetně hotovosti a syntetické hotovosti. Hotovost zahrnuje vklady, hotovostní zajištění, měnové spoty, měnové forwardy a další likvidní aktiva, například závazky a pohledávky. Pokud alokace zahrnuje deriváty, zahrnuje syntetická hotovost hotovostní ofsety derivátů.