

NN (L) Climate & Environment

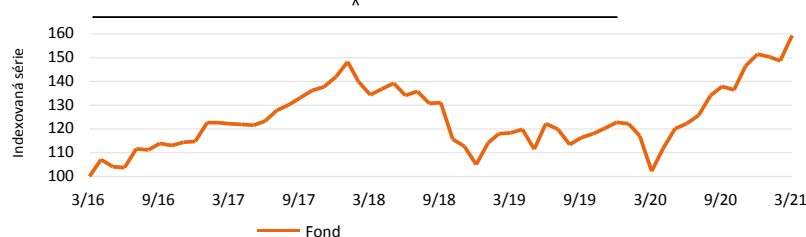
Management company: NN Investment Partners B.V.

Investiční politika

Fond je klasifikován jako finanční produkt s cílem dosáhnout udržitelných investic, jak je popsáno v článku 9 nařízení EU o zveřejňování informací souvisejících s udržitelností v odvětví finančních služeb. Fond využívá aktivní správu k zacílení na společnosti, které vytváří pozitivní dopad na sociální a životní prostředí a generují finanční výnos. Tento fond má tematický investiční přístup – zaměřuje své investice na společnosti, které pozitivně přispívají k cílům udržitelného rozvoje OSN spojeným s udržitelností přírodních zdrojů, jako jsou nedostatek vody, dostatek potravin, přenos energie a oběhová ekonomika. Proces výběru zahrnuje hodnocení dopadu, finanční analýzu a analýzu oblasti ESG (životní prostředí, sociální oblast a oblast řízení firem). K zařazení do fondu se kvalifikují zejména společnosti s pozitivním sociálním a environmentálním vlivem. V důsledku této zásady nebude fond investovat do společností s kontroverzními aktivitami a kontroverzním chováním v oblasti ESG nebo do společností, které porušují zásady globálních dohod, jako je ochrana lidských práv a ochrana životního prostředí. Neinvestujeme ani do společností zapojených například do vývoje, výroby, údržby či prodeje kontroverzních zbraní, výroby tabákových produktů nebo těžby topného uhlí či ropného písku. Dále platí přísnější omezení pro investice do společností, které se podílejí na činnostech souvisejících s hazardními hrami, zbraněmi, zábavou pro dospělé, kožšinami a speciální kůží, vrtnými operacemi v arktických oblastech a břídlíčnou ropou a plynem. Fond působí v globálním investičním prostředí, které odpovídá dlouhodobým společenským a environmentálním trendům. Fond se snaží přidat hodnotu analýzou společnosti a měřením zapojení a dopadu. Fond nemá referenční hodnotu. MSCI AC World (NR) se používá jako referenční index pro účely dlouhodobého srovnání finanční výkonnosti. Základní měnou dílčího fondu je euro (EUR) a tento fond může mít expozici vůči jiným měnám než euro. Zajištěním této třídy akcií usilujeme o výměnu základní měny fondu (EUR) za základní měnu této třídy akcií, kterou je česká koruna (CZK). Expozice vůči jiným měnám než CZK v tomto dílčím fondu u této třídy akcií zůstává. Zajištění měnového rizika spočívá ve vytvoření protikladné pozice v jiné měně. Pro tuto konkrétní zajištěnou třídu akcií neexistuje referenční index, jelikož používáme strategii měnového zajištění. Svůj podíl v tomto fondu můžete prodat každý (pracovní) den, kdy se také vyčíslovává jejich aktuální hodnota. Tento fond nemá za cíl vyplácet dividendy. Veškeré zisky fond dále investuje.

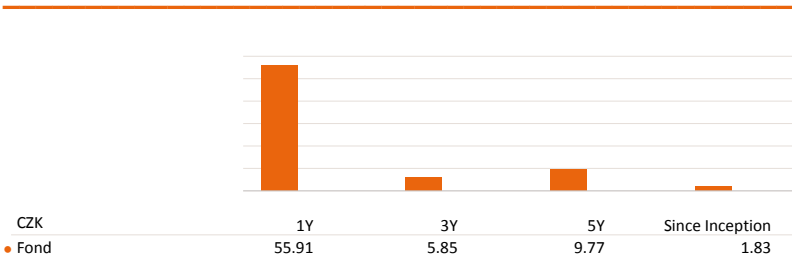
* Celková investiční politika byla převzata z dokumentu Klíčové informace pro investory (KIID). Kapitál a/nebo výnos nejsou garantované ani chráněné.

Čistá výkonnost (%) v minulosti *



^ Tento výkon byl dosažen v době, kdy měl fond jiné charakteristiky.

Čistá roční výkonnost (%) *



Základní údaje

| | |
|------------------------------|-------------------------------|
| Typ fondu | Akcie |
| Třída fondu | X Kapitalizační (zajištěná i) |
| Měna třídy fondu | CZK |
| Kód ISIN | LU0429746091 |
| Kód Bloomberg | INGMXCH LX |
| Kód Reuters | LU0429746091.LUF |
| Kód Telekurs | 10182004 |
| Kód WKN | A1CXBM |
| Kód Sedol | - |
| Domicil | LUX |
| Benchmark | No BM |
| Frekvence výpočtu ceny (NAV) | Denně |

Informace o fondu

| | |
|---|--------------|
| Datum založení fondu | 20/11/1997 |
| Datum založení třídy fondu | 24/08/2009 |
| Doba splatnosti podfondu | Neurčeno |
| Minimum subscription | akcie 1 |
| Čistá hodnota aktiv (NAV) | CZK 8,765.20 |
| Čistá hodnota aktiv na konci minulého měsíce | CZK 8,179.05 |
| Nejvyšší cena (NAV) za uplynulý rok (31.03.2021) | CZK 8,765.20 |
| Nejnižší cena (NAV) za uplynulý rok (01.04.2020) | CZK 5,445.10 |
| Celkový čistý objem aktiv fondu (Mln) | EUR 231.23 |
| Celková čistá hodnota aktiv na třídu fondu (mln.) | CZK 272.56 |
| Celková čistá hodnota investic (Mln) | EUR 232.10 |
| Počet vydaných podílových listů | 31,095 |

Poplatky

| | |
|---|-------|
| Poplatky hrazené z majetku fondu v průběhu roku (průběžný poplatek) | 2.32% |
| Roční poplatek za správu | 2.00% |
| Fixní servisní poplatek | 0.25% |
| Max. poplatek za úpis cenného papíru | 5.00% |
| Výstupní poplatek | - |

10 největších pozic

| | |
|------------------------------------|-------|
| SOLAREDDGE TECHNOLOGIES INC | 3.94% |
| BAKKAFROST | 3.91% |
| AMERICAN WATER WORKS INC | 3.77% |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA | 3.73% |
| DANAHER CORP | 3.70% |
| ECOLAB INC | 3.68% |
| HALMA PLC | 3.68% |
| VESTAS WIND SYSTEMS | 3.66% |
| ANSYS INC | 3.58% |
| DESCARTES SYSTEMS GROUP INC | 3.56% |

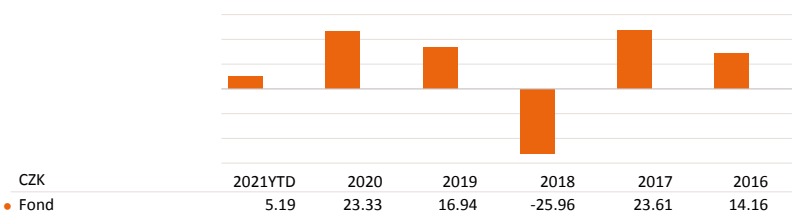
Právní upozornění

Věnujte prosím pozornost právnímu upozornění na konci dokumentu.

Informativní listy

NN (L) Climate & Environment

Čistá výkonnost v kalendářním roce (%) *



* Výkonnost v minulosti není spolehlivým indikátorem pro výnosy v budoucnosti. Výpočet bere v úvahu všechny poplatky a náklady, které na úrovni fondu vzniknou, s výjimkou poplatku za úpis. Jakékoli depozitní náklady, pokud jsou uplatněny, dodatečně sníží vývoj hodnoty.

Ukazatele

| CZK | 1 rok | 3 roky | 5 let |
|--|-------|--------|--------|
| Volatilita (směrodatná odchylka) | 12.35 | 18.29 | 15.83 |
| Sharpe ratio | 4.84 | 0.41 | 0.74 |
| Value at Risk na 95 % úrovni spolehlivosti | | | 33.95% |

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

Rizikový profil

| SRRI | Nižší riziko – Obvykle nižší výnos | | | Vyšší riziko – Obvykle vyšší výnos | | | |
|--------|------------------------------------|---|---|------------------------------------|---|---|---|
| | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 |
| Riziko | | | | | | | |

Historická data, například ta použitá k výpočtu tohoto ukazatele, nemusejí být spolehlivým vodítkem budoucího rizikového profilu tohoto fondu. Není zaručeno, že tento ukazatel rizika zůstane nezměněn, může se časem měnit. Nejvyšší kategorie rizika neznamená, že investice je bez rizika.

Tento fond je v kategorii 6 kvůli chování produktu během období měření výkonnosti. Celkové tržní riziko, se zohledněním minulé výkonnosti a budoucího potenciálního vývoje trhů, související s akciemi nebo finančními nástroji používanými k dosažení investičního cíle, je považováno za vysoké. Tyto finanční nástroje jsou ovlivňovány různými faktory. Patří mezi ně zejména vývoj finančních trhů a ekonomický vývoj emitentů těchto finančních nástrojů, kteří jsou sami ovlivňováni obecným stavem světové ekonomiky a ekonomickými a politickými podmínkami v jednotlivých zemích. Riziko likvidity podfondu je nastaveno jako střední. Rizika likvidity mohou nastat v případě, kdy je obtížné prodat specifickou podkladovou investici. Navíc mohou mít velký vliv na výkonnost podfondu i výkyvy měn. Investice s konkrétním zaměřením jsou mnohem více koncentrované než investice do různých společností. Investor nemá žádnou záruku, že původní investici získá zpět. Fond může investovat do akcií typu A (tj. akcie kotované na čínské pevnině) prostřednictvím systému Stock Connect, který usnadňuje investice do akcií na čínském trhu. Investice prostřednictvím tohoto systému podléhají specifickým rizikům včetně omezení kvót, obchodních omezení, stahování způsobilých akcií, zúčtovacího a vypořádacího rizika a regulačního rizika. Investorům doporučujeme, aby se seznámili s riziky tohoto systému uvedenými v prospektu. Zajišťování tříd akcií, což je metoda snažící se řídit specifické měnové riziko, může vést k dodatečnému kreditnímu riziku a zbytkovému tržnímu riziku v závislosti na účinnosti provedeného zajištění.

Údaje k 31.03.2021

Regionální rozdělení

| | |
|-----------------|--------|
| Evropa | 48.99% |
| Severní Amerika | 47.66% |
| Japonsko | 1.93% |
| Hotovost | 1.42% |

Měnové složení

| | |
|---------|--------|
| USD | 44.53% |
| EUR | 17.70% |
| NOK | 11.35% |
| DKK | 9.38% |
| GBP | 6.39% |
| Ostatní | 10.65% |

Odvětvová struktura

| | |
|---------------------------------------|--------|
| Elektrické Vybavení | 15.31% |
| Strojírenství | 13.48% |
| Software | 11.60% |
| Chemikálie | 9.40% |
| Stavebniny | 7.16% |
| Potravinářské Produkty | 6.52% |
| Profesionální Služby | 4.89% |
| Komerční Služby A Dodávky | 4.24% |
| Polovodiče A Polovodičové Vybavení | 3.94% |
| Dodávky Vody | 3.77% |
| Ostatní | 19.68% |

Právní upozornění

Věnujte prosím pozornost právnímu upozornění na konci dokumentu.

Informativní listy

NN (L) Climate & Environment

Právní upozornění

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.

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. 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.

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.

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.

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.

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.

Další informace o udržitelném cíli fondu naleznete v prospektu a na naší stránce SFDR na webu nnip.com.

Informativní listy

NN (L) Climate & Environment

Lexicon

Alfa: Alfa je mimořádná sazba z výnosu fondu – prostřednictvím aktivní správy – přes a nad výnos referenční hodnoty. V případě, že je alfa pozitivní, si fond vedl lépe a překonal svou referenční hodnotu.

Beta: Koefficient Beta ukazuje, jaká je volatilita fondu v porovnání se širokým trhem.

Burzovní daň: Jedná se o burzovní daň na čistou hodnotu aktiv vyjádřenou v procentech. Vaše banka nebo makléřská firma si strhne burzovní clo nebo daň za burzovní transakce, když koupíte nebo prodáte investiční fondy. Když nakupujete nově vydané akcie nebo dluhopisy, žádná burzovní daň se neplatí.

Celková čistá hodnota aktiv na třídu fondu (mln.): Celková spravovaná aktiva ve třídě akcií.

Celková čistá hodnota investic (Mln): Investice pod správou všech tříd akcií fondu.

Celkový čistý objem aktiv fondu (Mln): Kapitál pod správou všech tříd akcií fondu.

Celkový rating Morningstar: Celkový rating Morningstar je vážený průměr nezávislých ratingů.

Tracking Error: Volatilita (směrodatná odchylka) rozdílu mezi měsíčními výnosy fondu a jeho referenční hodnotou.

Čistá hodnota aktiv (ČHA): Čistá hodnota aktiv je cena podfondu. ČHA se počítá sečtením hodnot všech produktů, do kterých fond investoval, a následným vydělením výsledku počtem vydaných podílových listů.

Distribuce: Distribuční fondy pravidelně (většinou ročně) vyplácí dividendy, pokud v uplynulém roce dosáhly pozitivních výsledků. Dividendy ale nejsou předem dané a určuje si je každý fond sám. Mohou se tudíž z roku na rok výrazně lišit.

Dluhopisy s proměnlivou sazbou (floatery) Dluhopisy s proměnlivou sazbou jsou dluhopisy s různou sazbou.

Fixní servisní poplatek: Pro kompenzaci pravidelných nebo průběžných nákladů.

Fond: „Fond“ je běžně používaný termín pro provozování kolektivního investování. Termín může odkazovat na podfond belgického investičního fondu SICAV/BEVEK, podfond lucemburského investičního fondu SICAV/BEVEK, podílový fond nebo podfond podílového fondu.

Information ratio: Referenční hodnota pro riziko výnosu při posuzování výkonnosti fondu. Čím je information ratio vyšší, tím vyšší je dosažená míra návratnosti na jednotku rizika.

Kapitalizace: Kapitalizační fondy automaticky reinvestují veškeré výnosy nebo dividendy, aby hodnota původního kapitálu mohla neustále růst. V důsledku toho nevyplácí žádné dividendy.

Koeficient determinace: Měří vztah mezi portfoliem a referenční hodnotou a přináší vzhled do srovnatelnosti investičního portfolia proti zvolené referenční hodnotě. Výsledek blízký se 1

představuje silnou srovnatelnost, zatímco výsledky blízké se nule nejsou srovnatelné.

Max. poplatek za úpis cenného papíru: Jde o jednorázový poplatek pro kupujícího investičního fondu. Většinou se vyjadřuje jako procento z kapitálu, který investujete. Uvedené procento se nesmí překročit ani v případě maximálních vstupních nákladů.

Měna třídy akcií: Jedná se o měnu čisté hodnoty aktiv. V rámci jednoho podfondu mohou být třídy akcií v různých měnách.

Minimum subscription: Ukazuje minimální částku nebo minimální počet jednotek, které je do podfondu nutné investovat.

Nejnižší cena (NAV) za uplynulý rok (dd.mm.rrrr): Ukazuje nejnižší cenu fondu za uplynulý rok a také datum.

Nejvyšší cena (NAV) za uplynulý rok (dd.mm.rrrr): Ukazuje nejvyšší cenu fondu za uplynulý rok a také datum.

Oddíl: Investiční fond SICAV/BEVEK nebo podílový fond se mohou skládat z různých podfondů, které mají vlastní investiční politiku. Každý podfond se musí brát jako samostatný subjekt. Investor má nárok pouze na aktiva a výnos z podfondu, do kterého investoval.

Výstupní poplatek: Jedná se o jednorázový poplatek, který může být účtován, když chcete z investičního fondu odejít.

Platné zákony země: Domílcil nebo země podnikání je země, kde má investiční fond základnu. To může mít významné důsledky z hlediska daně.

Switch fee (max.): Poplatky za přechod nebo konverzní poplatky souvisí s přechodem z jednoho fondu do druhého. Tyto náklady hradí investor.

Poplatek za úschovu: Poplatek požadovaný finanční institucí od jejich zákazníků za držení movitého majetku.

Poplatky hrazené z majetku fondu v průběhu roku (průběžný poplatek): Celkové roční periodické náklady na investiční fond se vyjadřují jako procento. Většinou obsahují správní poplatek, administrativní poplatky, publikační poplatky atd.

Průměrný úvěrový rating: Průměrný úvěrový rating fondu se zakládá na průměrném úvěrovém ratingu součástí fondu. Pro výpočet složeného/průměrného ratingu na úrovni nástroje se používají ratingy společnosti Moody, Fitch a S&P. Složený rating se používá jako průměr na základě dostupnosti kreditních ratingů. Tento složený rating se vypočítává pro nástroj stálých příjmů Stanovení kreditní kvality je v rozsahu od vysokého („AAA“ až „AA“) přes střední („A“ až „BBB“) po nízké („BB“, „B“, „CCC“, „CC“ až „C“).

Rating Morningstar na 3 let: Rating (kvantitativní) počítaný na tříleté období, který bere v úvahu minulou návratnost a veškeré výkyvy cen.

Rating Morningstar na 5 let: Rating (kvantitativní) počítaný na pětileté období, který bere v úvahu minulou návratnost a veškeré výkyvy cen.

Rating Morningstar: Morningstar je vedoucí dodavatel nezávislých investičních výzkumů. Ratingy Morningstar umožňují investorům pochopit minulou výkonnost investičního fondu a také berou v úvahu riziko. Nejlepších 10 % v každé kategorii získá pět hvězd. Další 22,5 % získá čtyři hvězdy. Střed, 35 %, získá tři hvězdy. Další 22,5 % získá dvě hvězdy a 10 % s nehoršími výkony získá 1 hvězdu. Fond získá rating pouze v případě, že existuje nejméně tři roky.

Benchmark: Předem daná, objektivně měřená, porovnává se vůči ní návratnost investice.

Roční poplatek za správu: Poplatek za správu jsou roční náklady vyjádřené v procentech. Tento poplatek nebude účtován, když nakoupíte fond. Poplatek bude stržen jednou ročně z výnosu fondu. Jedná se o platbu správě fondu.

Sharpe ratio: Sharpe ratio ukazuje výkonnost fondu po úpravě s ohledem na riziko. Čím je Sharpe ratio vyšší, tím lépe je výkonnost fondu upravená pro riziko.

Sicav: SICAV/BEVEK představuje „Société d'Investissement à Capital Variable/ Beleggingsvennootschap met Veranderlijk Kapitaal“. Jedná se o otevřený kolektivní investiční fond. Investiční fond SICAV/BEVEK je statutárním subjektem kolektivního investování, právní entitou a většinou společností s ručením omezeným. Typickou vlastností investičního fondu SICAV/BEVEK je, že může trvale zvyšovat svůj kapitál i bez formalit, a to vydáním nových podílů na snížení kapitálu koupí stávajících podílů.

Složení podle ratingu: Kreditní kvalita jednotlivých dluhopisů je dána soukromými nezávislými ratingovými agenturami, například Standard & Poor's, Moody's a BarCap & Fitch. Jejich stanovení kreditní kvality je v rozsahu od vysokého („AAA“ až „AA“) přes střední („A“ až „BBB“) po nízké („BB“, „B“, „CCC“, „CC“ až „C“). Investiční stupeň dluhopisů (rating „AAA“ až „BBB“) má obvykle nižší úroveň rizika než dluhopisy s ratingem „BB“ až „C“, které se považují za dluhopisy s nízkou kreditní kvalitou.

Swing factor: Swingové oceňování má za cíl snížit efekt zeslabení způsobený, když významné operace v rámci podfondu nutí správce nakupovat nebo prodávat svá podkladová aktiva. U těchto transakcí vznikají transakční poplatky a daně, které mají vliv na hodnotu fondu a také na všechny jeho investory. Tam, kde se uplatňuje swingová tvorba cen, je cena čisté hodnoty aktiv podfondu nastavena na určitou částku, pokud hlavní tok přesáhne určitou prahovou hodnotu (swingový faktor). Tato částka je určena k vyrovnání očekávaných transakčních poplatků vyplývajících z rozdílu mezi příchodím a odchodním kapitálem. Swingovou tvorbu cen lze použít pouze při mimořádných příležitostech, pokud vůbec. Pro další informace a nejnovější čísla se podívejte na webovou stránku nnip.be a přejděte do oddílu „Zásady a řízení“ pod záložkou „O nás“.

Durace: Měří citlivost úrokové sazby cen dluhopisů. Čím delší je zbývající průměrný termín dluhopisů ve fondu (delší trvání), tím více budou ceny dluhopisů odpovídat změně úrokové sazby. Pokud úroková sazba stoupne, cena dluhopisu klesne a naopak.

Typ fondu: Ukazuje typ fondu: akciový fond, dluhopisový fond, fond peněžního trhu, strukturovaný fond (s nějakou formou ochrany kapitálu), multi-asset fond nebo smíšený fond.

Risk and return indicator: Toto je indikátor syntetického rizika a odměny (SRRI, Synthetic Risk Return Indicator). Ukazuje zákonem nařízené rizikové skóre na škále od 1 (nízké riziko, typicky s nižší návratností) po 7 (vysocé rizikové, typicky s vyšší návratností). Výpočet se zakládá na volatilitě podfondu, takže bere v úvahu kolísání obchodních cen na trhu. Výpočty volatility obvykle pokrývají období pěti let.

Var: Value at Risk (hodnota při riziku) odkazuje na maximální možnou ztrátu, kterou může fond během roku utrpět, a to s 95% úrovní spolehlivosti.

Volatilita (směrodatná odchylka): Volatilita (směrodatná odchylka) vypovídá o možnosti kolísání sazby v daném rozmezí pro následující období. V případě výrazné směrodatné odchylky (= vysoká volatilita) hovoříme o velkém rozsahu možných výsledků.

Výkonnost: Ukazuje, jak se hodnota investičního fondu zvyšovala (nebo snižovala) během daného období. Výnos bere v potaz průběžné náklady, ale žádné vstupní poplatky, výstupní poplatky ani daně.

Výnos do nejhoršího data splatnosti: Výnos do nejhoršího data splatnosti měří nejnižší možný výnos, který lze získat z dluhopisu (vypověditelného), který plně funguje v rámci podmínek smlouvy.