EQUITIES

FIXED INCOME

MULTI ASSET

STRUCTURED

MONEY MARKET

Informativní listy Marketingový materiál

NN (L) International Czech Bond

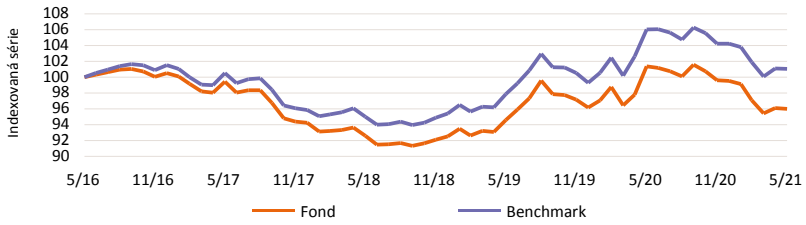
Management company: NN Investment Partners B.V.

Investiční politika

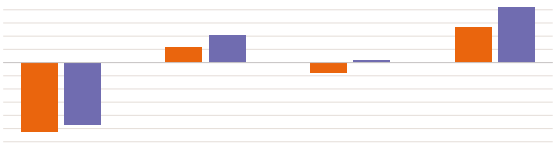
Cílem tohoto fondu je realizovat dlouhodobý růst kapitálu investováním do diverzifikovaného portfolia dluhopisů denominovaných v českých korunách. Patří sem dluhopisy emitované českou vládou, obcemi a firmami a také emise českých dceřiných firem mezinárodních společností. Používáme fundamentální i kvantitativní výzkumné vstupy pro investice do dluhopisů s atraktivní úrokovou sazbou, o kterých si myslíme, že mají relativně nízké riziko platební neschopnosti a které jsou kotovány na oficiální burze cenných papírů nebo na jiném regulovaném trhu. Fond používá aktivní správu s cílem zaměřit se na nejslibnější emise a sektory s ohledem na náš pohled na vývoj úrokových sazeb, pohled na různé země a náš pohled na trhy s pevným výnosem obecně, přičemž limity odchylek durace zůstávají zachovány vzhledem k referenční hodnotě. Pozice fondu se proto může významně odchýlit od referenční hodnoty. V horizontu několika let usilujeme o překonání výkonnosti referenční hodnoty 100% BofA Merrill Lynch Czech Governments Index. Referenční hodnota široce odráží naše investiční prostředí. Fond může rovněž zahrnovat investice do dluhopisů, které nejsou součástí prostředí referenčních hodnot. Akcie fondu můžete prodat každý (pracovní) den, kdy se také vypočítává jejich aktuální hodnota. Cílem fondu je výplata pravidelných dividend.

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

Čistá výkonnost (%) v minulosti *



Čistá roční výkonnost (%) *



CZK	1Y	3Y	5Y	Since Inception
Fond	-5.29	1.21	-0.81	2.66
Benchmark	-4.69	2.08	0.21	4.21

Údaje k 31.05.2021

Základní údaje

Typ fondu	Pevný výnos
Třída fondu	P růstová
Měna třídy fondu	CZK
Kód ISIN	LU0120667166
Kód Bloomberg	INGCBDD LX
Kód Reuters	LU0120667166.LUF
Kód Telekurs	1162621
Kód WKN	983746
Kód Sedol	-
Domicil	LUX
Benchmark	ICE BofA Merrill Lynch Czech Republic Government
Frekvence výpočtu ceny (NAV)	Denně

Informace o fondu

Datum založení fondu		18/08/1997
Datum založení třídy fondu		10/11/2000
Doba splatnosti podfondu		Neurčeno
Minimum subscription	akcie	1
Čistá hodnota aktiv (NAV)	CZK	1,635.47
Čistá hodnota aktiv na konci minulého měsíce	CZK	1,637.22
Nejvyšší cena (NAV) za uplynulý rok (02.06.2020)	CZK	1,737.85
Nejnižší cena (NAV) za uplynulý rok (30.03.2021)	CZK	1,624.86
Celkový čistý objem aktiv fondu (Mln)	CZK	5,776.69
Celková čistá hodnota aktiv na třídu fondu (mln.)	CZK	4.69
Celková čistá hodnota investic (Mln)	CZK	5,779.18
Počet vydaných podílových listů		2,867
Durace		6.59
Průměrný úvěrový rating		AA-
Výnos do splatnosti		1.92
Výnos do nejhoršího data splatnosti		1.92

Poplatky

Poplatky hrazené z majetku fondu v průběhu roku (průběžný poplatek)	1.30%
Roční poplatek za správu	1.00%
Fixní servisní poplatek	0.25%
Max. poplatek za úpis cenného papíru	5.00%
Výstupní poplatek	-

10 největších pozic

CZECH REPUBLIC	RegS 2.400% 2025-09-17	11.68%
CZECH REPUBLIC	1.250% 2025-02-14	10.52%
CZECH REPUBLIC	RegS 1.000% 2026-06-26	10.24%
CZECH REPUBLIC	RegS 0.450% 2023-10-25	9.07%
CZECH REPUBLIC	RegS 2.500% 2028-08-25	8.48%
CZECH REPUBLIC	2.750% 2029-07-23	7.41%
CZECH REPUBLIC	RegS 4.200% 2036-12-04	7.29%
CZECH REPUBLIC	RegS 4.850% 2057-11-26	6.51%
CZECH REPUBLIC	2.000% 2033-10-13	3.66%
CZECH REPUBLIC	1.200% 2031-03-13	3.40%

Právní upozornění

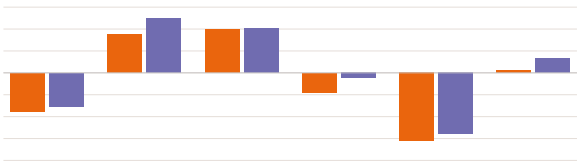
Věnujte prosím pozornost právnímu upozornění na konci dokumentu.

NN investment partners

Informativní listy

NN (L) International Czech Bond

Čistá výkonnost v kalendářním roce (%) *



CZK	2021YTD	2020	2019	2018	2017	2016
Fond	-3.55	3.51	3.93	-1.82	-6.24	0.24
Benchmark	-3.05	4.97	4.07	-0.46	-5.59	1.32

* 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)	3.19	4.40	3.88
Sharpe ratio	-1.18	0.39	-0.04
Alfa	-0.85	-0.79	-1.01
Koeficient Beta	0.95	0.97	0.97
Koeficient determinace	0.98	0.97	0.97
Information ratio	-1.17	-1.14	-1.61
Tracking Error	0.52	0.76	0.63
Value at Risk na 95 % úrovni spolehlivosti			6.37%

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. Nejnižší kategorie rizika neznamená, že investice je bez rizika.

Tento fond je v kategorii 3 kvůli chování produktu během období měření výkonnosti. Celkové tržní riziko, se zohledněním minulé výkonnosti a budoucího potenciálního vývoje trhů, související s dluhopisy používanými k dosažení investičního cíle, je považováno za střední.
Tyto finanční nástroje jsou ovlivňovány různými faktory. K nim patří (nikoliv však výlučně) vývoj na finančních trzích, vývoj hospodaření emitentů těchto nástrojů, kteří jsou sami ovlivňováni celkovou situací globální ekonomiky a hospodářskými a politickými podmínkami v každé zemi. Očekávané úvěrové riziko, riziko selhání emitentů podkladových investic, je střední. Likviditní riziko fondu je stanoveno jako střední. Likviditní rizika vznikají tam, kde je obtížné prodat určitou podkladovou investici, což může způsobit potenciální těžkosti při odkupu vaší investice z fondu. Navíc mohou mít velký vliv na výkonnost podfondu i výkyvy měn. Investice do konkrétní geografické oblasti jsou mnohem více koncentrované než investice do různých geografických oblastí. Investor nemá žádnou záruku, že původní investici získá zpět.

Hrubá dividenda

Rok	2021 YTD	2020	2019	2018	2017
CZK	4.60	9.60	8.44	7.20	18.40

Údaje k 31.05.2021

Regionální rozdělení

Česká republika	89.57%
Rozvíjející se trhy	3.24%
Rakousko	1.84%
Nadnárodní	1.47%
Německo	1.34%
Lucembursko	1.13%
Francie	0.88%
Hotovost	0.47%
Syntetická Hotovost	0.07%

Měnové složení

CZK	99.99%
USD	3.21%
ZAR	0.01%
EUR	-3.22%
Ostatní	0.01%

Složení podle ratingu

AA	86.18%
A	0.88%
BBB	2.23%
Hotovost	0.47%
Nehodnoceno	10.25%

Sektorová rozložení

Pokladny	86.12%
Prostředky	4.37%
Finančnictví	4.05%
Energie	2.43%
Nadnárodní	1.47%
Průmysl	1.02%
Hotovost	0.47%
Syntetická Hotovost	0.07%

Ostatní třídy fondu

I kapitalizační	CZK	LU1086912398
X růstová	CZK	LU0094967691
X kapitalizační	CZK	LU0094967261
P kapitalizační	CZK	LU0082087437

Právní upozornění

Věnujte prosím pozornost právnímu upozornění na konci dokumentu.

Informativní listy

NN (L) International Czech Bond

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 přinášejí 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 integraci rizik spojených s udržitelností naleznete na naší stránce SFDR na webu nnip.com.

Informativní listy

NN (L) International Czech Bond

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.
Benchmark: Předem daná, objektivně měřená, porovnává se vůči ní návratnost investice.
Beta: Koeficient 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 strhnou 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.
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.
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.
Equities: Akcie.
Fixed Income: Pevný výnos.
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 vhled do srovnatelnosti investičního portfolia proti zvolené referenční hodnotě. Výsledek blížící se 1 představuje silnou srovnatelnost, zatímco výsledky blížící 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.
Money Market: Peněžní trh.
Multi Asset: Multi-Asset.
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.
Platné zákony země: Domicil nebo země podnikání je země, kde má investiční fond základnu. To může mít významné důsledky z hlediska danění.
Poplatek za úschovu: Poplatek požadovaný finanční institucí od jejích 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 společností 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.
Ratingy Morningstar: Společnost Morningstar je nezávislý poskytovatel investičních výzkumů. Rating Morningstar představuje kvantitativní hodnocení výkonnosti fondu v minulosti. Bere v úvahu rizika a poplatky spojené s fondem. Rating nebere v úvahu žádné kvalitativní prvky a počítá se pomocí (matematického) vzorce. Fondy jsou kategorizovány a srovnávány s podobnými fondy na základě jejich skóre. Poté jsou ohodnoceny 1 až 5 hvězdičkami. V každé kategorii obdrží prvních 10 % 5 hvězdiček, následujících 22,5 % 4 hvězdičky, následujících 35 % 3 hvězdičky, následujících 22,5% 2 hvězdičky a zbývajících 10 % 1 hvězdičku. Rating se počítá na měsíční bázi, bere v úvahu výkonnost v minulosti z období 3, 5 a 10 let a zároveň nebere v úvahu budoucí trhy či výkonnost.
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 rizika. 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“. Investiční fond SICAV/BEVEK je statutárním subjektem kolektivního investování, právní entitou a většinou společnost s ručením omezeným. Typickou vlastností investiční 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.
Structured: Strukturované produkty.
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 příchozím a odchozím kapitálem. Swingovou tvorbu cen lze použít pouze při mimořádných příležitostech, pokud vůbec. Pro další informace a nejnovější čísla se podívejte na webové stránky nnip.be a přejděte do oddílu „Zásady a řízení“ pod záložkou „O nás“.
Switch fee (max.): Poplatky za přechod nebo konverzní poplatky souvisí s přechodem z jednoho fondu do druhého. Tyto náklady hradí investor.
Tracking Error: Volatilita (směrodatná odchylka) rozdílu mezi měsíčními výnosy fondu a jeho referenční hodnotou.
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 (vysoce 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.
Vážená průměrná splatnost: Vážená průměrná splatnost je vyjádřená počtem let, je vážená váhou cenných papírů v portfoliu, což umožňuje odhadnout citlivost na úrokovou sazbu fondu peněžního trhu. Čím vyšší je vážená průměrná splatnost, tím větší je dopad změny úrokové sazby na cenu portfolia.
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.
Výnos do splatnosti: Výnos do splatnosti je výnos z investice do dluhopisu za předpokladu, že byl držen až do konce splatnosti.
Výstupní poplatek: Jedná se o jednorázový poplatek, který může být účtován, když chcete z investičního fondu odejít.