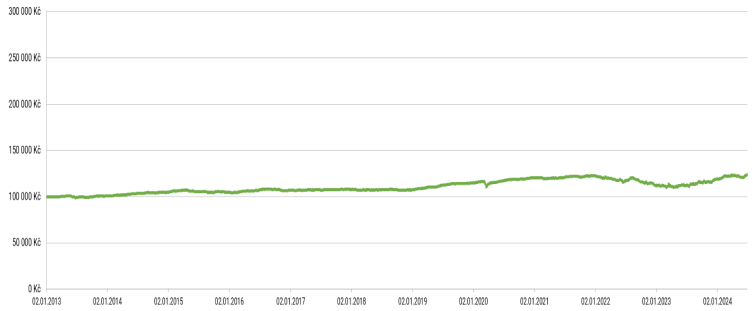
EDWARD ESG modelové portfolio 3

strategie

ESG: BlackRock opatrná



Cílem ESG opatrné strategie je dlouhodobě dosahovat zhodnocení lehce nad úrovní inflace při velmi mírném kolísání celkové hodnoty portfolia. Zhruba 85 % portfolia je tvořeno pevně úročenými nástroji a hotovostí. Většinou se jedná o bezpečné státní dluhopisy, doplněné o korporátní dluhopisy a dluhopisy rozvojových zemí. Okolo 15% pak tvoří globální akcie, jejichž cílem je přinášet do portfolia dlouhodobě zisk a vyvažovat rizika spojená se změnou úrokových sazeb a inflací. Do portfolia jsou zařazovány ETF fondy, které zohledňují všechny ESG faktory zodpovědného investování, jako nižší emise uhlíku, etické pracovní prostředí nebo genderově vyvážený management.

Výsledky simulují vývoj vybraného modelového portfolia zajištěného do CZK (od října 2022 bez měnového zajištění). Nejsou-li pro jednotlivé ETF v portfoliu dostupné historické ceny pro celé zobrazované období, je jejich starší vývoj pro účely simulace nahrazen vývojem indexu, které ETF sledují. Simulace zohledňuje rebalancování, náklady na měnové zajištění i náklady spojené s řízením portfolia. Výsledky jsou kalkulovány s manažerským poplatkem 1,99 % pro modelová portfolia MP4-MP10 a s poplatkem max. 0,25 % pro modelová portfolia MP2-MP3.
Upozorňujeme, že modelace má své limitace, indexy nejsou zatížené vnitřní nákladovostí a tracking error jako ETF. Vstupní poplatky nejsou pro účely simulace uvažovány.
Použité údaje se týkají minulosti. Mějte na paměti, že výkonnost v minulosti není zárukou ani spolehlivým ukazatelem budoucích výnosů.

ČISTÉ VÝNOSY do 30.6.2024 za poslední:

	Roční (p.a.)	Kumulativní
1 měsíc		2,34%
3 měsíce		0,13%
6 měcíců		3,58%
1 rok	10,07%	10,07%
3 roky	0,74%	2,24%
5 let	1,91%	9,91%
10 let	1,78%	19,30%

ČISTÉ KALENDÁŘNÍ VÝNOSY

	Výnos v roce
2024	3,59%
2023	6,64%
2022	-8,76%
2021	1,68%
2020	4,79%
2019	7,08%
2018	-0,50%
2017	0,84%
2016	2,18%
2015	-0,26%
2014	4,24%
2013	0,80%

Složení fondů

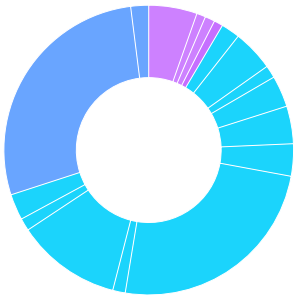
Vybrané investiční nástroje		Zastoupení
Akcie		8,5%
Americké ESG akcie	iShares MSCI USA SRI UCITS ETF	5,4%
Americké ESG akcie s min. kolísavostí	iShares Edge MSCI USA Minimum Volatility ESG UCITS ETF	0,0%
Evropské SRI akcie	iShares MSCI Europe SRI UCITS ETF	1,0%
SRI akcie rozvojových států	iShares MSCI EM SRI UCITS ETF USD	1,1%
Japonské SRI akcie	Xtrackers - Japan SRI (EUR)	1,0%
Akcie z Pacifiku bez Japonska	iShares MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF	0,0%
Akcie se zaměřením na čistou energii	iShares Global Clean Energy UCITS ETF	0,0%
Dluhopisy		61,5%
ESG korporátní dluhopisy v USD	iShares $ Corp Bond ESG UCITS ETF	2,1%
ESG korporátní dluhopisy v EUR	iShares € Corp Bond ESG UCITS ETF	4,6%
ESG dluhopisy rozvojových zemí	iShares J.P. Morgan ESG $ EM Bond UCITS ETF	1,4%
ESG rizikové korporátní dluhopisy	iShares $ High Yield Corp Bond ESG UCITS ETF	3,5%
Zelené dluhopisy	Lyxor Green Bond DR UCITS ETF	4,2%
Čínské státní dluhopisy	iShares China CNY Bond UCITS ETF	0,0%
Americké 20+leté státní dluhopisy	iShares $ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF	3,6%
Americke 1-3leté státní dluhopisy	iShares $ Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF	24,7%
Americké protiinflační dluhopisy	iShares $ TIPS 0-5 UCITS ETF	1,4%
Evropské klimatické státní dluhopisy	iShares € Govt Bond Climate UCITS ETF	11,7%
Evropské protiinflační dluhopisy	iShares € Inflation Linked Govt Bond UCITS ETF	1,4%
Eurové 1-3leté státní dluhopisy	iShares € Govt Bond 1-3yr UCITS ETF EUR (Acc)	2,9%
Hotovost		30%
Úročená hotovost	Úročená hotovost	28,0%
Rezervní hotovost	Rezervní hotovost	2,0%

TER	**0,09%**
Očekávaný výnos (10 let)	**3,69%**
ESG Skóre vyšší o	**5,89% ***
Snížení uhlíkové stopy o	**12,71% ***

Rizikovost portfolia

1 2 3 4 5 6 7 8 9 10

*srovnání mezi standardním modelovým portfoliem Edward a odpovídajícím ESG portfoliem

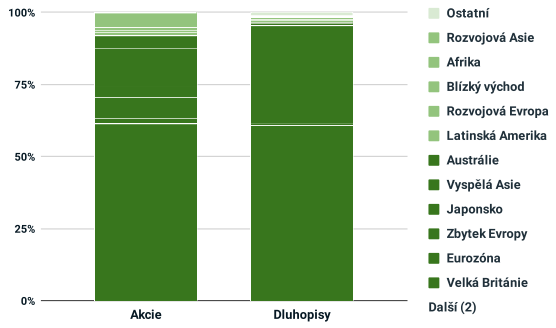


- Americké ESG akcie
- Evropské SRI akcie
- SRI akcie rozvojových států
- Japonské SRI akcie
- ESG korporátní dluhopisy v USD
- ESG korporátní dluhopisy v EUR
- ESG dluhopisy rozvojových zemí
- ESG rizikové korporátní dluhopisy
- Zelené dluhopisy
- Americké 20+leté státní dluhopisy
- Americke 1-3leté státní dluhopisy
- Americké protiinflační dluhopisy
- Evropské klimatické státní dluhopisy
- Evropské protiinflační dluhopisy
- Eurové 1-3leté státní dluhopisy

Další (2)

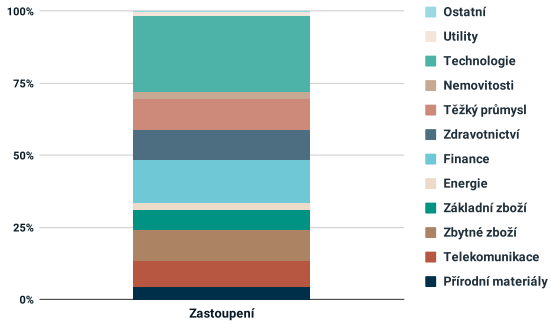
Regionální rozložení

Zařazení	Oblast	Akcie	Dluhopisy
Vyspělé země	USA	61,7%	60,9%
	Kanada	0,0%	0,1%
	Velká Británie	1,9%	0,8%
	Eurozóna	7,1%	33,6%
	Zbytek Evropy	4,2%	1,0%
	Japonsko	12,7%	0,2%
	Vyspělá Asie	4,4%	0,1%
	Austrálie	0,0%	0,2%
Rozvíjející se země	Latinská Amerika	1,3%	0,5%
	Rozvojová Evropa	0,2%	0,4%
	Blízký východ	0,5%	0,6%
	Afrika	1,0%	0,2%
	Rozvojová Asie	5,0%	0,4%
Ostatní		0,0%	0,9%



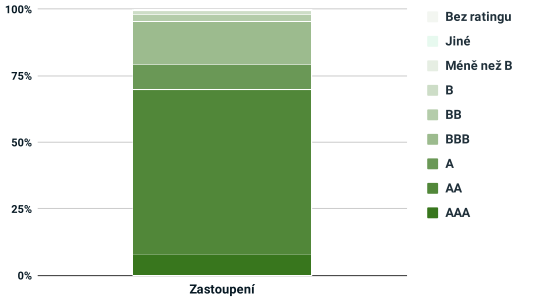
Akcie: Sektorové rozložení

Oblast	Zastoupení
Přírodní materiály	4,2%
Telekomunikace	9,2%
Zbytné zboží	10,7%
Základní zboží	6,8%
Energie	2,6%
Finance	14,9%
Zdravotnictví	10,3%
Těžký průmysl	11,1%
Nemovitosti	2,3%
Technologie	26,5%
Utility	1,5%
Ostatní	0,0%



Dluhopisy: Úvěrový rating a durace

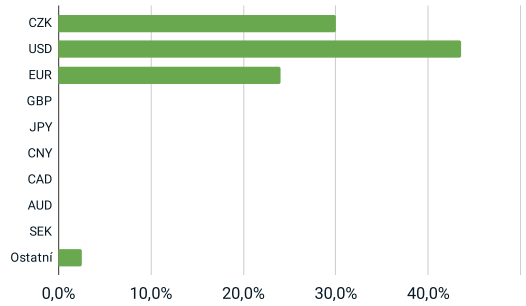
Oblast	Zastoupení
AAA	8,3%
AA	61,7%
A	9,6%
BBB	16,0%
BB	2,5%
B	1,4%
Méně než B	0,5%
Jiné	0,0%
Bez ratingu	0,0%
Průměrná efektivní durace	4,8 let

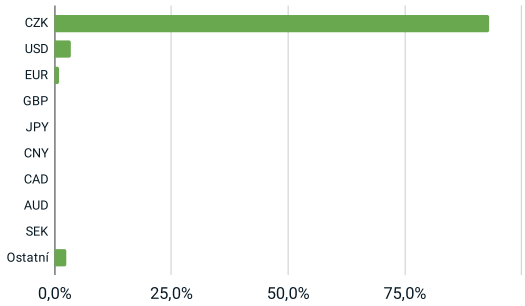


Měnové rozložení

Nezajištěno	
Měna	Zastoupení
CZK	30,0%
USD	43,5%
EUR	24,0%
GBP	0,0%
JPY	0,0%
CNY	0,0%
CAD	0,0%
AUD	0,0%
SEK	0,0%
Ostatní	2,5%

Zajištěno	
Měna	Zastoupení
CZK	93,0%
USD	3,5%
EUR	1,0%
GBP	0,0%
JPY	0,0%
CNY	0,0%
CAD	0,0%
AUD	0,0%
SEK	0,0%
Ostatní	2,5%





Hodnoty procentuálního zastoupení jsou zaokrouhleny na jedno desetinné místo