

Strategie

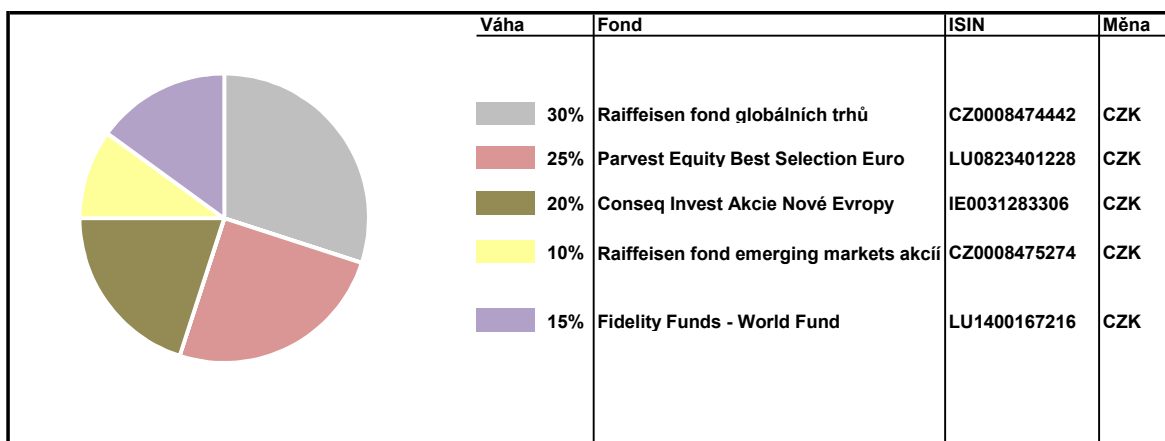
Se strategií EQUITY vznikla celosvětově diversifikovaná akciová strategie. Cílem je, aby se dlouhodobě orientovaní investoři mohli podílet na historicky vyšších výnosech na akciových trzích. Pro akcie je charakteristická vyšší volatilita (kolísavost cen), toto riziko řídí strategie EQUITY širokou regionální diversifikací produktů. Pro snížení rizik je rovněž možné alokovat až 20 % svěřených prostředků do fondů peněžního trhu.

Těžiště leží s 55 % ve fondech s globálním působením, dále v 25 % v evropských fondech a 20 % v akciových fondech zaměřených na střední a východní Evropu.

Vývoj hodnoty v CZK



Rozložení aktiv



Měsíční výkonnost v %* (CZK)

	I	II	III	IV	V	VI	VII	VIII	IX	X	XI	XII	Rok
2019	6,62	3,30	1,05	3,52	-4,82	3,86	1,21	-3,10					11,69
2018	2,32	-2,39	-4,15	3,39	1,84	-2,41	2,67	-0,86	-0,08	-6,03	1,29	-7,14	-11,58
2017	1,55	1,73	1,54	1,54	0,10	-0,11	-1,04	-0,80	2,38	2,92	-1,14	0,74	9,71
2016	-8,27	-0,75	3,14	1,57	1,08	-4,05	5,92	1,02	0,00	1,07	1,01	3,97	5,06
2015	6,75	4,41	3,17	1,85	1,30	-5,41	0,08	-8,54	-4,84	9,75	2,36	-4,11	5,30
2014	-1,98	2,31	-0,32	0,50	4,37	0,87	1,15	1,77	-0,47	-0,11	3,61	-0,14	11,98
2013	4,60	1,39	2,88	-0,01	2,27	-4,62	3,30	-2,34	4,15	2,39	6,74	-0,14	22,03
2012	2,82	2,75	-0,10	0,02	-0,88	0,54	4,06	-1,70	1,58	-0,12	1,98	1,58	13,09
2011	-5,53	0,97	-0,02	-1,53	0,99	-3,17	-12,17	-0,78	6,81	6,34	-1,59	5,00	-6,09
2010	-1,55	-0,26	4,70	1,44	-4,46	-0,23	-1,83	-1,36	1,76	1,93	3,04	5,28	8,33
2009	5,54	-5,31	-1,19	7,76	4,93	-2,69	3,72	2,14	1,41	4,40	-1,53	4,98	25,98
2008	-11,78	-2,68	-5,40	5,38	1,41	-12,87	-2,56	2,87	-14,10	-18,27	-1,29	-1,52	-48,26
2007	4,57	0,38	-1,25	2,43	2,50	2,23	-4,78	-3,05	1,26	-0,29	-8,03	2,20	-2,53
2006											-1,24	1,95	0,69

Riziková data

Měsíční volatilita**	3,89%
Roční volatilita	14,03%
Sharpe ratio***	-0,23
Maximální pokles (za měsíc)	-18,27%

Vývoj hodnoty za posl. období

1 měsíc	-3,10%
3 měsíce	1,86%
6 měsíců	1,41%
1 rok	-1,36%

Vývoj hodnoty

Od 16.10.2006	12,69%
Měsíční průměr	0,21%

* Výkonnost programu: vývoj jednotlivých fondů v investičním programu

** Volatilita: míra průměrné intenzity kolísání kurzů cenných papírů (směrodatná odchylka)

*** Sharpe ratio: hodnota poměru výnos/riziko (čím vyšší je tato hodnota, tím lépe pro investora)