

AKTÍVNE RIADENÉ
DYNAMICKÉ PORTFÓLIO



OMNIUM 1



Omnium Capital o.c.p., a.s.

OMNIUM 1

ZÁKLADNÉ CHARAKTERISTIKY PRAVIDELNEJ INVESTÍCIE

GEOGRAFICKÉ ZAMERANIE

USA

INVESTIČNÝ HORIZONT

Dlhodobý (5 a viac rokov)

RIZIKOVOSŤ

„6“ vyššie riziko

CIEĽOVÁ HRUBÁ VÝNOSNOSŤ

> 10 % p.a.

LIKVIDITA

Od dátumu žiadosti o predaj portfólia = t+3 dni

OPTIMÁLNA PRAVIDELNÁ INVESTÍCIA

100,- EUR / mesačne

*Upozornenie: Cieľová hrubá výnosnosť nie je garantovaná a je odhadovaná na základe simulovanej a historickej výkonnosti portfólia.

PORTFOLIO MANAGER

Portfólio manažér spoločnosti OMNIUM CAPITAL disponuje praktickými ako aj teoretickými skúsenosťami z oblasti riadenia akciových portfólií. V najväčšej slovenskej banke pôsobil niekoľko rokov na pozícii finančného analytika a v konzultačnej firme sa profesionálne venoval oblasti oceňovania firiem. Na Fakulte managementu UK Bratislava dlhodobo pôsobí ako vysokoškolský pedagóg, kde vedie predmety finančný manažment a oceňovanie podnikov. Vyučuje na Automotive MBA kurze so zameraním na Corporate Finance pod záštitou Vienna University of Technology.

Publikoval vedeckú monografiu na tému oceňovania podnikov a je spoluautorom niekoľkých knižných publikácií a príspevkov pre medzinárodné vedecké konferencie so zameraním na bankovníctvo a financie. Je pravidelným prispievateľom do slovenských ekonomických periodík. Patrí medzi najdlhších nepretržitých používateľov finančného systému Bloomberg Professional Terminal na Slovensku.



Mgr. MARTIN VOŽÁR, PhD.

 www.linkedin.com/in/vozar-martin

INVESTIČNÝ CIEĽ



Aktívne riadené dynamické portfólio Omnium 1 umožňuje klientom pravidelne investovať aj relatívne malé sumy do vybraného TOP akciového indexu obchodovaného na americkej burze cenných papierov prostredníctvom vybraného replikačného aktíva obchodovaného na vybranej európskej burze cenných papierov.

Cieľom portfólia je dosahovať obdobný výnos, ako bude dosahovať stanovený širokospektrálny akciový index zameraný na akcie obchodované v USA.

Portfólio umožní investorom participovať aj s malými pravidelnými vkladmi na zhodnocovaní najlepších svetových akciových titulov.

Zdroj hodnoty portfólia bude tvoriť kapitálový a dividendový výnos a výnos z pohybu menových párov.

NÁSTROJE PRE MANAŽMENT PORTFÓLIA

Snaha o pravidelne prekonávanie globálnych akciových benchmarkov akými sú indexy S&P 500 a STOXX Europe 600 je kľúčová v našich aktivitách. V Omnim Capital preto používame špičkové finančné softwarové technológie a aplikujeme najnovšie teoretické poznatky z oblasti portfólio a finančného manažmentu. Snažíme sa tieto zdroje využívať na maximum tak, aby sme dosiahli náš cieľ.

Pri manažovaní portfólia je využívaný ako pracovný nástroj Bloomberg Professional Terminal. Spoločnosť Bloomberg patrí medzi TOP lídrov v oblasti poskytovania finančných informácií na globálnej úrovni.

Bloomberg Terminal umožňuje efektívne riadenie akciových portfólií, nakoľko ponúka komplexné informácie v reálnom čase

o finančnom a nefinančnom vývoji jednotlivých druhov aktív, národno-hospodárske informácie o stave jednotlivých ekonomík, informácie o akciových a iných finančných indexoch, komentáre analytikov, kvalifikované odhady, analýzy, ako aj kľúčové informácie o vývoji v takej podstatnej oblasti, ako je koronavírus.

Na základe dlhoročných skúsenosti portfólio manažéra s využívaním systému Bloomberg pre účely portfólio manažmentu je možné aj v slovenských podmienkach prekonávať globálny Benchmark a porovnávať sa s dosahovanými výnosmi s TOP globálnymi správcami aktív.



ZHODNOTENIE PORTFÓLIA

Portfólio Omnium 1 sa za 5 rokov
(od 1. 1. 2017 do 31. 12. 2021)
celkovo zhodnotilo o 116,61 %, teda o 16,71 % p.a.



Vývoj simulovanej kumulovanej percentuálnej historickej výkonnosti portfólia od 1. 1. 2017 do 31. 12. 2021 (1. 1. 2017 = 0 %).

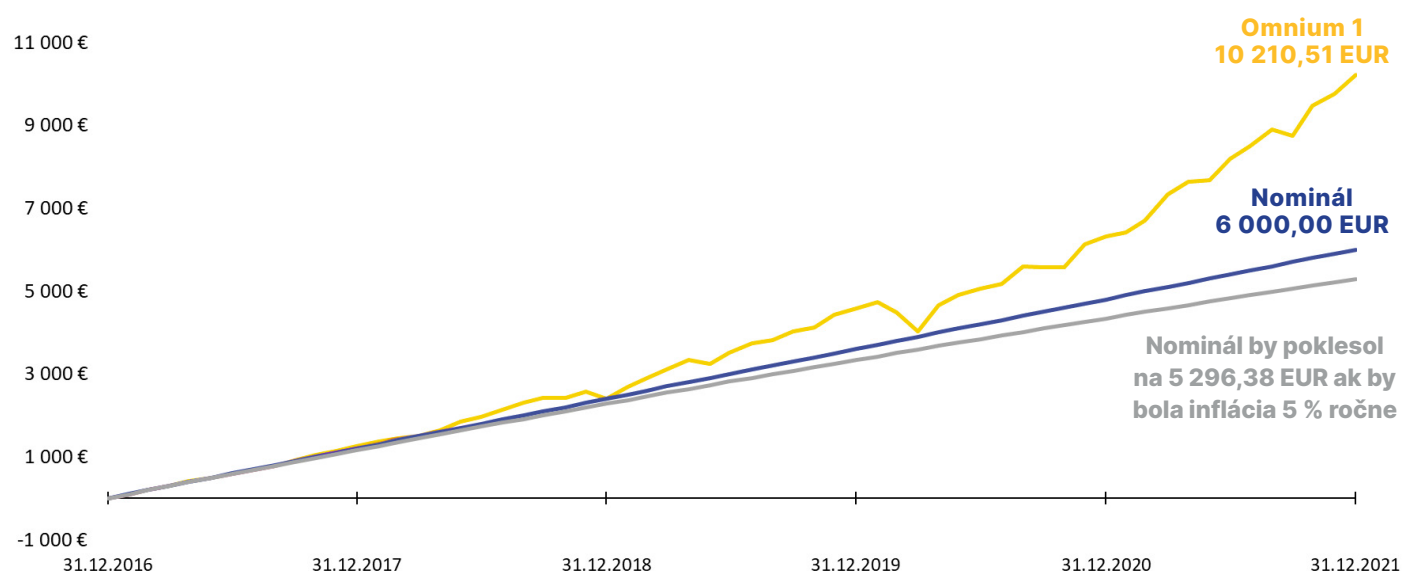
Zdroj: Omnium Capital, Bloomberg Professional Terminal.

Všetky výnosy sú uvedené v mene EUR a sú uvedené pred odrátaním poplatkov, provízií a pred zdanením. Zobrazené údaje sa týkajú minulosti. Výkonnosť v minulosti nie je spoľahlivým ukazovateľom budúcich výsledkov.

ZHODNOTENIE PORTFÓLIA

Pravidelná investícia vo výške 100 EUR mesačne do Omnium 1 by sa za 5 rokov (od 1. 1. 2017 do 31. 12. 2021) celkovo zhodnotila na 10 210,51 EUR. Ak by sa neinvestovalo potom by 100 EUR mesačne dosiahlo za 5 rokov (60 mesiacov) hodnotu 6 000,00 EUR. **Investícia do Omnium 1 by tak vytvorila hrubý výnos vo výške 4 210,51 EUR.**

Ak by bola inflácia na úrovni 5 % ročne potom by sa 100 EUR mesačne za 5 rokov postupne znehodnotilo na hodnotu 5 296,38 EUR. To znamená akoby ste odkladali namiesto 100 EUR mesačne iba 88,27 EUR.



Vývoj simulovanej kumulovanej percentuálnej historickej výkonnosti portfólia od 1. 1. 2017 do 31. 12. 2021 (1. 1. 2017 = 0 %): 1. ak by sa mesačne investovalo 100 EUR pri zhodnotení o 16,71% p.a. (1,28% p.m.), 2. ak by sa mesačne odkladala nominálna suma 100 EUR bez jej zainvestovania, 3. ak by sa mesačne odkladala nominálna suma 100 EUR bez jej zainvestovania a inflácia by dosiahla 5% ročne.

Zdroj: Omnium Capital, Bloomberg Professional Terminal.

Všetky výnosy sú uvedené v mene EUR a sú uvedené pred odrátaním poplatkov, provízií a pred zdanením. Zobrazené údaje sa týkajú minulosti. Výkonnosť v minulosti nie je spoľahlivým ukazovateľom budúcich výsledkov.

ROZŠÍRENÉ CHARAKTERISTIKY INVESTÍCIE

Mena portfólia:	EUR
Efektivita investície:	Sharpe Ratio 0,96*
Rizikovosť investície:	Štandardná odchýlka 20,01* Historical 3 Year Simulation VaR95 1D -1,97**

Typy rizík:	Menové, akciové a trhové riziko
Kapitálová záruka:	Nie
Zaistenie (hedging):	Realizované v prípade potreby
Likvidita:	100% (pri obvyklých trhových podmienkach)
Zdaňovanie:	FO nemusí v SR zdaňovať kapitálové výnosy z CP, ktoré sú obchodné nna burze a ktoré vlastní > 1 rok.

VYHODNOTENIE RIZIKOVOSTI INVESTÍCIE



* Počítané na základe simulovanej historickej výkonnosti v minulosti na časovej perióde 1 300 obchodných dní počas 5 rokov (od 31. 12. 2016 do 31. 12. 2021).

** Simulované historické VaR95, výpočet realizovaný k 31. 12. 2021, pri výpočtoch bol využitý Bloomberg Risk Model, metóda: „Historical 3 Year Simulation“. Výpočet bol uskutočnený na Bloomberg Professional Terminal. VaR95 1D = s pravdepodobnosťou na úrovni 95 %, môžeme povedať, že portfólio nevytvorí vyššiu stratu v rámci jedného obchodného dňa ako je uvedené, tj. zo 100 obchodných dní by portfólio nemalo vytvoriť vyššiu stratu počas 95 obchodných dní, vo zvyšných piatich dňoch strata portfólia môže byť prekročená.



Omniium Capital

Investície do finančných nástrojov obsiahnutých v tejto investičnej stratégii sú spojené s rizikom. Hodnota investície a výnos z nej plynúci môže rásť alebo klesať a nie je zaručená návratnosť pôvodne investovanej sumy. Výkonnosť v minulosti nie je spoľahlivým ukazovateľom výkonnosti v budúcnosti. Na tento dokument sa nemožno spoliehať ako na vysvetlenie všetkých rizík spojených s investovaním do uvedeného portfólia, podrobné informácie o rizikách sú uvedené v dokumente Informácie o finančných nástrojoch a s nimi spojenými rizikami, ktorý sa nachádza na webovom sídle.

Tento dokument je vlastníctvom spoločnosti Omniium Capital, o.c.p., a.s., akékoľvek jeho ďalšie použitie, rozmnožovanie, zverejňovanie, kopírovanie dokumentu alebo jeho častí si vyžaduje predchádzajúci súhlas spoločnosti.

www.omniiumcapital.sk

