

Investičná stratégia: **Vyvážené portfólio ARISTOCRAT DIVIDEND**

Obhospodarovateľ portfólia / Obchodník s cennými papiermi :

Obchodné meno : **OMNIUM CAPITAL, o.c.p., a.s.**
so sídlom : Žižkova 9, 811 02 Bratislava – mestská časť Staré Mesto
IČO : 51 306 573
zastúpený : Bc. Martin Vajay, predseda predstavenstva
Údaje o registrácii : Obchodný register OS Bratislava I., oddiel : Sa, vložka č.: 6712/B

Klient :

Meno a priezvisko :
Rodné číslo :
Trvale bytom :

- Účel produktu:
 - Portfólio by malo zabezpečiť primeranú diverzifikáciu investícií a majetku klienta. Zameriava sa na investície do tzv. dividendových firiem (akcií), ktoré pôsobia výlučne v Eurozóne. Zdroje hodnoty portfólia budú tvoriť kapitálový a dividendový výnos.
- Stratégia produktu:
 - Cieľom portfólia Aristocrat Dividend je pravidelné prekonávanie Benchmarku, tj. vytváranie nadhodnoty (tzv. kladná „Alpha“). Manažment portfólia je realizovaný na základe Markowitzovej teórie efektívnych portfólií. Uvedený koncept sa snaží o realizáciu tzv. produktu diverzifikácie, teda minimalizovať riziko portfólia pri relatívnom zachovaní jeho výnosu. Portfólio investuje do vybraného a obmedzeného počtu akcií firiem, selektovaných na základe fundamentálnej a technickej analýzy. Výber spoločností podlieha úvodnému predvýberu jednotlivých priemyselných sektorov, ktoré sú analyzované z pohľadu ich potenciálu prekonať celkovým rastom priemerný rast HDP Eurozóny. V rámci sektora sú následne vyselektované kľúčové firmy, ktoré by sa mali podieľať na raste vybraných sektorov najväčšou mierou a zároveň, ktoré majú potenciál prinášať nadštandardný dividendový výnos, pričom zároveň budú dosahovať nadštandardné kľúčové finančné pomerové ukazovatele.
- Portfólio bude investovať iba do nasledovných typov finančných nástrojov:
 - Akcie
 - ETF – Exchange Traded Fund (regulačné štruktúry: Grantor Trust, Unit Investment Trust a Open-End Investment Company).
- Geografické rozdelenie podľa krajín na ktorých budú investície realizované:
 - Eurozóna
- Rozdelenie finančných nástrojov podľa meny (percentuálny podiel na portfóliu MIN/MAX):
 - Euro - EUR (0/100)
- Rozdelenie podľa regulovaných trhov na ktorých budú investície realizované:
 - Regulovaný trh Eurozóny
 - Regulovaný trh Veľkej Británie
- Predpokladaný investičný horizont:
 - strednodobý (1 až 5 rokov)
- Maximálny podiel jedného finančného nástroja v portfóliu:

- 25% (v deň nákupu)
- Maximálny počet finančných nástrojov v portfóliu:
 - 30
- Podiely jednotlivých podkladových tried aktív na portfóliu (percentuálny podiel na portfóliu MIN/MAX):
 - Akcie (0/100)
 - Hotovosť (0/100)
- Optimálna hodnota investície:
 - 50 000,- EUR, alebo ekvivalent v inej mene.
- Riziko portfólia a pomer rizika k podstupovanému výnosu budú merané a priebežne vyhodnocované nasledovnými metódami:
 - **Metóda VaR95** (pravdepodobnosť 95%, že portfólio by nemalo vytvoriť vyššiu stratu v rámci jedného obchodného dňa, tj. zo 100 obchodných dní by portfólio nemalo nevytvoriť vyššiu stratu počas 95 dní, vo zvyšných piatich dňoch strata portfólia môže byť prekročená):

Výška rizika	Trieda rizík	Produkt	Intervaly VaR95 1d *	
			od	do
	1		0,00%	0,30%
Nízke riziko	2		0,30%	0,60%
	3		0,60%	1,00%
Stredné riziko	4		1,00%	1,50%
	5	Aristocrat Dividend	1,50%	2,10%
Vysoké riziko	6		2,10%	2,80%
	7		2,80%	<

- **Sharpe Ratio** – ukazovateľ meria vzťah podstupovaného rizika k očakávanému výnosu (tzv. efektívnosť investície):

Produkt	Trieda efektívnosti	Sharpe ratio (na ročnej báze)*	
		od	do
	1	0,10	0,50
Aristocrat Dividend	2	0,50	1,00
	3	1,00	<

* V určitých časových periódach je možné, že stanovené hranice budú prekonané. Nastavenie je určené pre časový horizont 1 rok.

- **Analýza scenárov vývoja (Scenario Analysis):**

Scenár	Aristocrat Dividend - P&L
COVID-19 Crisis - Feb/Mar 2020	-39,97%
Lehman Brothers Default - 2008	-18,77%
US Debt Ceiling Crisis & Downgrade in 2011	-16,28%
Equities down 10%	-13,93%
Oil prices Drop - May 2010	-9,97%
Japan Earthquake in Mar 2011	-5,79%
Greece Financial Crisis - 2015	-4,98%
EUR down 10% vs. USD	-3,36%
Libya Oil Shock - Feb 2011	-2,07%
EUR up 10% vs. USD	3,36%
Equities up 10%	13,94%
Equity Markets Rebound in 2009	46,03%

Pri výpočtoch bol využitý Bloomberg Risk Model, výpočet uskutočnený na Bloomberg Professional Terminal; hodnoty sú uvedené v mene EUR. Metodika k dispozícii na požiadanie.

- Rebalancing:
 - Stratégia zastúpenia jednotlivých finančných nástrojov v portfóliu sa bude vyhodnocovať raz za kvartál.
- Minimálna trhovú kapitalizácia finančného nástroja nadobudnutého do portfólia:
 - 10 mld. EUR (v deň nákupu)
- Minimálna požiadavka na likviditu finančného nástroja:
 - Zobchodovaný priemerný denný objem za posledných 30 dní 500 000 EUR (v deň nákupu)
- Benchmark (Bloomberg Ticker):
 - SPDR S&P Euro Dividend Aristocrats UCITS ETF (SPYW GR)

Vyhlásenia :

Na základe vyhodnotenia znalostí a skúseností klienta v oblasti investícií, jeho finančnú situáciu vrátane jeho schopnosti znášať stratu a jeho investičné ciele, určil Obhospodarovateľ klientovi túto investičnú stratégiu „**Vyvážené portfólio Aristocrat Dividend**“.

Klient udeľuje Obhospodarovateľovi súhlas s investičnou stratégiou „**Vyvážené portfólio Aristocrat Dividend**“. Klient ďalej prehlasuje, že sa dôkladne oboznámil s touto investičnou stratégiou, a že táto investičná stratégia zodpovedá jeho znalostiam a skúsenostiam, ako aj investičným cieľom, ktoré si zvolil. Klient porozumel rizikám, ktoré súvisia s touto investičnou stratégiou.

Za účelom realizovania investičnej stratégie „**Vyvážené portfólio Aristocrat Dividend**“ sa Klient zaväzuje investovať peňažné prostriedky vo výške EUR.

Táto zmluva bola uzatvorená elektronicky dňa prostredníctvom webového portálu OMNIUM CAPITAL, o.c.p., a.s. na adrese <https://omniumcapital.sk>