

## Investičná stratégia: **Dynamické portfólio Defense**

### **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/Názov :  
Rodné číslo/IČO :  
Trvale bytom/Sídlo :

- Účel produktu:
  - o Aktívne riadené dynamické portfólio Defense umožňuje klientom investovať do vybraných aktív zo sektora obranného a vojenského priemyslu.
- Stratégia produktu:
  - o Cieľom portfólia je pravidelné prekonávanie benchmarku (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 umožňuje klientom participovať na zmene hodnoty globálne pôsobiacich spoločností z obranného a vojenského sektora a to bezpečnou a efektívnou formou prostredníctvom služby riadeného portfólia. Všetky firmy zaradené do portfólia budú výlučne verejne obchodované spoločnosti zo západných krajín, resp. z krajín, ktoré sú v aliancii s USA. Zdroj hodnoty portfólia tvoria: kapitálový výnos, dividendový výnos a výnos z pohybu menových párov.
- Portfólio bude investovať iba do nasledovných typov finančných nástrojov:
  - o Akcie
  - o ETF – Exchange Traded Fund (tj. ETF, Grantor Trust a Unit Investment Trust podľa amerického práva).
- Geografické rozdelenie podľa krajín na ktorých budú investície realizované:
  - o USA
  - o Eurozóna
  - o Veľká Británia
  - o Izrael
  - o Japonsko
  - o Južná Kórea
- Rozdelenie finančných nástrojov podľa meny (percentuálny podiel na portfóliu MIN/MAX):
  - o Americký dolár - USD (0/100)
  - o Euro - EUR (0/100)
  - o Britská libra – GBP (0/100)
  - o Izraelský šekel - ILS (0/100)
  - o Japonský jen – JPY (0/100)
  - o Kórejský won – KRW (0/100)
- Rozdelenie podľa regulovaných trhov na ktorých budú investície realizované:

- o Regulovaný trh USA
  - o Regulovaný trh Eurozóny
  - o Regulovaný trh Veľkej Británie
  - o Regulovaný trh Izraela
  - o Regulovaný trh Japonska
  - o Regulovaný trh Južnej Kórei
- Predpokladaný investičný horizont:
    - o strednodobý (3 až 5 rokov)
  - Maximálny podiel jedného finančného nástroja v portfóliu:
    - o 50% (v deň nákupu)
  - Maximálny počet finančných nástrojov v portfóliu:
    - o 20
  - Podiely jednotlivých podkladových tried aktív na portfóliu (percentuálny podiel na portfóliu MIN/MAX):
    - o Akcie (0/100)
    - o ETF – Exchange Traded Fund (0/100)
    - o Hotovosť (0/100)
  - Optimálna hodnota investície:
    - o 30 000,- EUR, alebo ekvivalent v inej mene.
  - Mena portfólia:
    - o Euro - EUR
  - Riziko portfólia a pomer rizika k podstupovanému výnosu (tzv. efektívnosť investície) budú merané a priebežne vyhodnocované nasledovnými metódami:
    - o **Metóda VaR95 1d (Value-at-Risk)** pravdepodobnosť 95%, že portfólio nevytvorí vyššiu stratu v rámci jedného obchodného dňa, ako je vypočítaná, tj. zo 100 obchodných dní by portfólio nemalo vytvoriť vyššiu stratu počas 95 dní, vo zvyšných piatich dňoch strata portfólia môže byť vyššia, ako je vypočítaná:

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

Pri výpočtoch VaR bol využitý Bloomberg Risk Model, metóda: "Historical 3 Year Simulation", výpočet uskutočnený na Bloomberg Professional Terminal; hodnoty sú uvedené už po prepočítaní portfólií do meny EUR.

\* V určitých časových periódoch je možné, že stanovené hranice budú prekonalé. Nastavenie je určené pre časový horizont 1 rok.

- o **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
	2	0,50	1,00
<b>Defense</b>	<b>3</b>	<b>1,00</b>	<b>&lt;</b>

\* V určitých časových periódoch je možné, že stanovené hranice budú preknané. Nastavenie je určené pre časový horizont 1 rok.

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

Scenár	P&L: Defense
COVID-19 drop Feb/Mar 2020	-43,52%
Russian Financial Crisis - 2008	-37,37%
Lehman Default - 2008	-21,60%
Debt Ceiling Crisis & Downgrade in 2011	-20,14%
Equities down 10%	-15,42%
Oil prices Drop - May 2010	-8,28%
Japan Earthquake in Mar 2011	-4,80%
Libya Oil Shock - Feb 2011	-4,22%
Greece Financial Crisis - 2015	-3,71%
EUR up 10% vs. USD	-1,73%
EUR down 10% vs. USD	1,73%
Equities up 10%	15,42%
Equity Markets Rebound in 2009	25,37%
Equity Markets Rebound after 1st COVID wave	43,80%

Výpočet bol uskutočnený na Bloomberg Professional Terminal, pri výpočtoch bol využitý Global Multi-Asset Model; výpočty sú realizované po prepočte do meny EUR. Metodika k dispozícii na požiadanie.

- Rebalancing:
  - o Stratégia zastúpenia jednotlivých finančných nástrojov - aktív v portfóliu sa bude vyhodnocovať raz za kvartál.
- Minimálna trhovú kapitalizácia finančného nástroja nadobudnutého do portfólia:
  - o 1 mld. EUR (v deň nákupu)
- Minimálna požiadavka na likviditu finančného nástroja:
  - o Zobchodovaný priemerný denný objem za posledných 30 dní (v deň nákupu) 10 mil. USD
- Benchmark (Ticker):
  - o 0,5 x S&P 500 Index (SPX Index) + 0,5 x STOXX Europe 600 Index (SXXP Index)

**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 „**Dynamické portfólio Defense**“.

Klient udeľuje Obhospodarovateľovi súhlas s investičnou stratégiou „**Dynamické portfólio Defense**“. 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 „**Dynamické portfólio Defense**“ 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>**