

INVESTIČNÁ STRATÉGIA: Dynamické portfólio OMNIUM 1

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:

- 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.

• Stratégia produktu:

- Cieľom portfólia je dosahovať obdobný výnos, ako bude dosahovať stanovený širokospektrálny akciový index zameraný na akcie obchodované v USA. Zdroj hodnoty portfólia bude tvoriť kapitálový výnos a výnos z pohybu menových párov.

• Portfólio bude investovať iba do nasledovných typov finančných nástrojov:

- Akcie
- ETF – Exchange Traded Fund (tj. ETF, Grantor Trust a Unit Investment Trust podľa amerického práva, Open-ended UCITS podľa európskeho práva).

• Geografické rozdelenie podľa krajín na ktorých budú investície realizované:

- USA
- Eurozóna
- Veľká Británia

• Rozdelenie finančných nástrojov podľa meny (percentuálny podiel na portfóliu MIN/MAX):

- Americký dolár - USD (0/100)
- Euro - EUR (0/100)
- Britská libra – GBP (0/100)

• Rozdelenie podľa regulovaných trhov na ktorých budú investície realizované:

- Regulovaný trh USA
- Regulovaný trh Eurozóny
- Regulovaný trh Veľkej Británie

• Predpokladaný investičný horizont:

- dlhodobý (5 a viac rokov)

• Maximálny podiel jedného finančného nástroja v portfóliu:

- 100% (v deň nákupu)

• Maximálny počet finančných nástrojov v portfóliu:

- 5

• Podiely jednotlivých podkladových tried aktív na portfóliu (percentuálny podiel na portfóliu MIN/MAX):

- Akcie (0/100)

- ETF – Exchange Traded Fund (tj. ETF, Grantor Trust a Unit Investment Trust podľa amerického práva, Open-ended UCITS podľa európskeho práva) (0/100)
- Hotovosť (0/100)
- **Minimálna hodnota pravidelnej investície:**
 - 50 EUR / mesačne
- **Minimálna cieľová suma:**
 - 3 000 EUR
- **Mena portfólia**
 - Euro - EUR
- **Riziko portfólia a pomer rizika k podstupovanému výnosu (tzv. efektivita investície) budú merané a priebežne vyhodnocované nasledovnými metódami:**
 - **Metódou 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 rizik	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	Omnium 1	2,10 %	2,80 %
	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 periódach je možné, že stanovené hranice budú prekročené. Nastavenie je určené pre časový horizont 1 rok.

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

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

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

◦ **Analýza scenárov historického vývoja „zisku a strát“ portfólia (Scenario Analysis)**

Scenár	P&L: Omnium 1
COVID-19 drop - Feb/Mar 2020	-36,64 %
Russian Financial Crisis - 2008	-30,30 %
Debt Ceiling Crisis & Downgrade in 2011	-17,76 %
Lehman Default - 2008	-16,59 %
Equities down 10%	-13,15 %
EUR up 10% vs. USD	-5,00 %
Libya Oil Shock - Feb 2011	-3,91 %
Oil prices Drop - May 2010	-2,81 %
Japan Earthquake in Mar 2011	-2,52 %
Greece Financial Crisis - 2015	-0,33 %
EUR down 10% vs. USD	5,00 %
EUR up 10 % vs. USD	13,15 %
Equity Markets Rebound in 2009	20,39 %
Equity Markets Rebound after 1st COVID wave	36,03 %

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

• **Rebalancing:**

- Stratégia zastúpenia jednotlivých finančných nástrojov - aktív v portfóliu sa bude vyhodnocovať minimálne raz za kvartál.

• **Minimálna trhová kapitalizácia finančného nástroja nadobudnutého do portfólia:**

- 1 mld. EUR (v deň nákupu)

• **Minimálna požiadavka na likviditu finančného nástroja:**

- Zobchodovaný priemerný objem za posledných 30 dní (v deň nákupu) 1 mil. EUR

• **Benchmark (Ticker):**

- Neaplikuje sa

• **Replikačný index:**

- S&P 500 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 Omnium 1**“.

Klient udeľuje Obhospodarovateľovi súhlas s investičnou stratégiou „**Dynamické portfólio Omnium 1**“. 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 Omnium 1**“ sa Klient zaväzuje investovať peňažné prostriedky vo výške za nasledovných podmienok:

Investičný horizont (minimálne 5 rokov): rokov

Výška pravidelnej mesačnej investície (minimálne 50 EUR): EUR

Cieľová suma (minimálne 3 000 EUR): EUR

Vlastnoručný podpis klienta: