



Omnium Capital

Správa o vývoji hrubého zhodnotenia portfólia EQUITY US za obdobie: od 1.1.2020 do 31.12.2024

Dátum vypracovania: 13.1.2025

*Vypracoval:
Mgr. Martin Vozár, PhD.
Portfolio Manager
Omnium Capital, o.c.p., a.s.
E-mail: martin.vozar@omniumcapital.sk*

Webový odkaz na brožúru portfólia:

Equity US

*Webový odkaz na príklady znázorňujúce kumulatívny účinok
nákladov na návratnosť investície:*

Nákladovosť

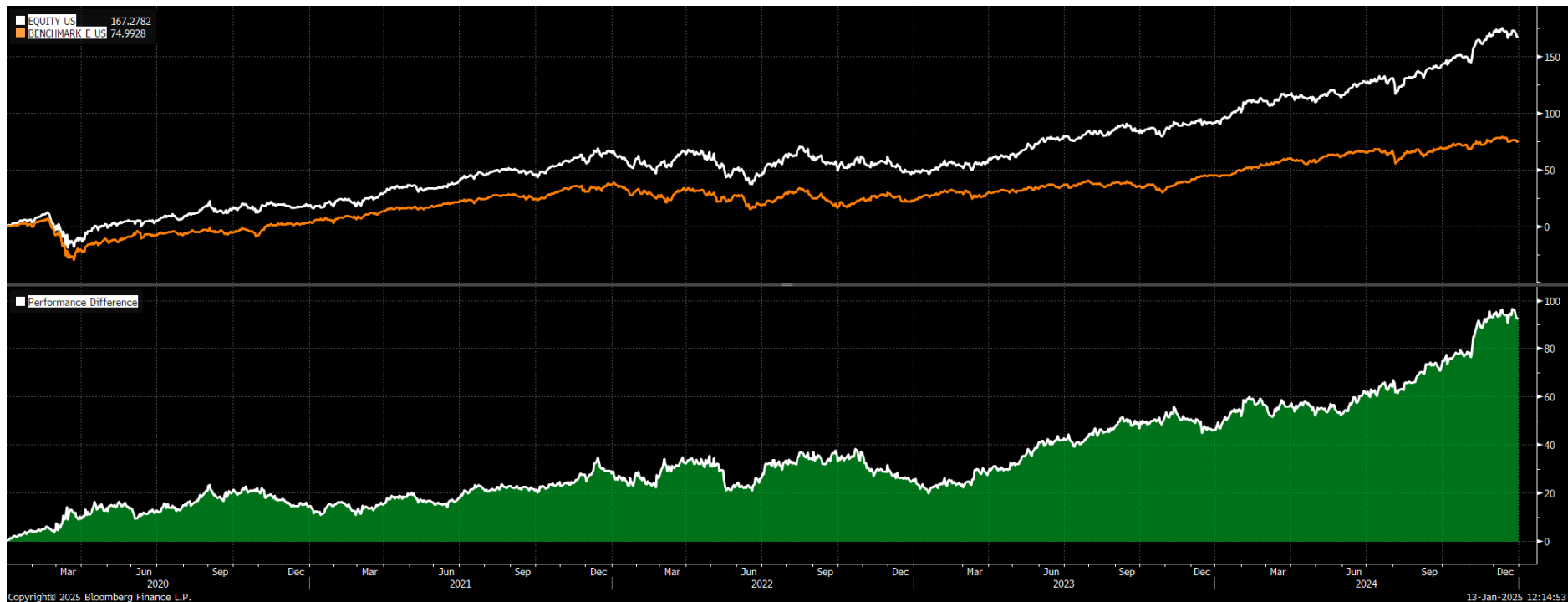


Spoločnosť Omnium Capital o.c.p., a.s. začala poskytovať službu riadeného portfólia v rámci investičnej stratégie Dynamické portfólio Equity US dňa 1.5.2020. Zobrazená historická výkonnosť portfólia pred uvedeným dátum preto zobrazuje simulovanú historickú výkonnosť portfólia.



Vývoj hrubého percentuálneho zhodnotenia portfólia za obdobie od 1.1.2020 do 31.12.2024

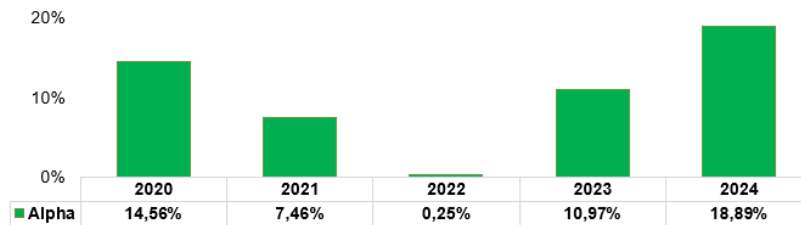
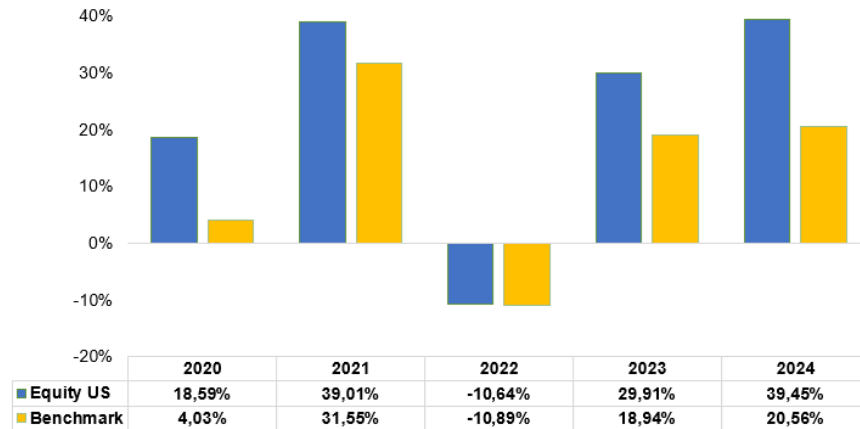
Za obdobie od 1.1.2020 do 31.12.2024 sa hrubá hodnota portfólia na percentuálnej báze zmenila v mene EUR o 167,28%. V porovnaní s benchmarkom vytvorilo portfólio za uvedenú časovú periódu rozdiel vo výnosoch („Alpha“) na úrovni 92,29%.



Vývoj historického simulovaného (od 1.1.2020 do 30.4.2020) a historického (od 1.5.2020 do 31.12.2024) celkového hrubého percentuálneho zhodnotenia portfólia a benchmarku a vývoj parametra „Alpha“ (rozdiel medzi výnosmi portfólia a benchmarku); 1.1.2020 = 0%. Všetky výnosy sú prepočítané do meny EUR a sú uvedené pred odrátaním poplatkov, provízií a pred zdanením. Zdroj: autor, Bloomberg Professional Terminal. Zobrazené údaje sa týkajú minulosti. Výkonnosť v minulosti nie je spoľahlivým ukazovateľom budúcich výsledkov. Výnos sa môže zvýšiť alebo znížiť v dôsledku menových výkyvov. Údaje o zhodnotení sú založené na hrubej výkonnosti. Príklad kumulatívneho účinku nákladov na návratnosť investície je uvedený prostredníctvom webového odkazu, ktorý je uvedený na prvej strane tejto správy.



Súhrnná štatistika hrubého percentuálneho zhodnotenia portfólia za roky 2020 až 2024



	2020	2021	2022	2023	2024	AVERAGE return	Total Return	p.a.
Equity US	18,59%	39,01%	-10,64%	29,91%	39,45%	23,26%	167,28%	21,72%
Benchmark	4,03%	31,55%	-10,89%	18,94%	20,56%	12,84%	74,99%	11,83%
Alpha	14,56%	7,46%	0,25%	10,97%	18,89%	10,43%	92,29%	13,96%

Kumulatívny hrubý výnos portfólia počítaný na anualizovanej báze dosiahol od 1.1.2020 do 31.12.2024 úroveň 21,72% p.a.

Kumulatívny hrubý priemerný výnos portfólia dosiahol od 1.1.2020 do 31.12.2024 úroveň 23,26%

Kumulatívna hrubá Alpha počítaná na anualizovanej báze dosiahla od 1.1.2020 do 31.12.2024 úroveň 13,96% p.a.

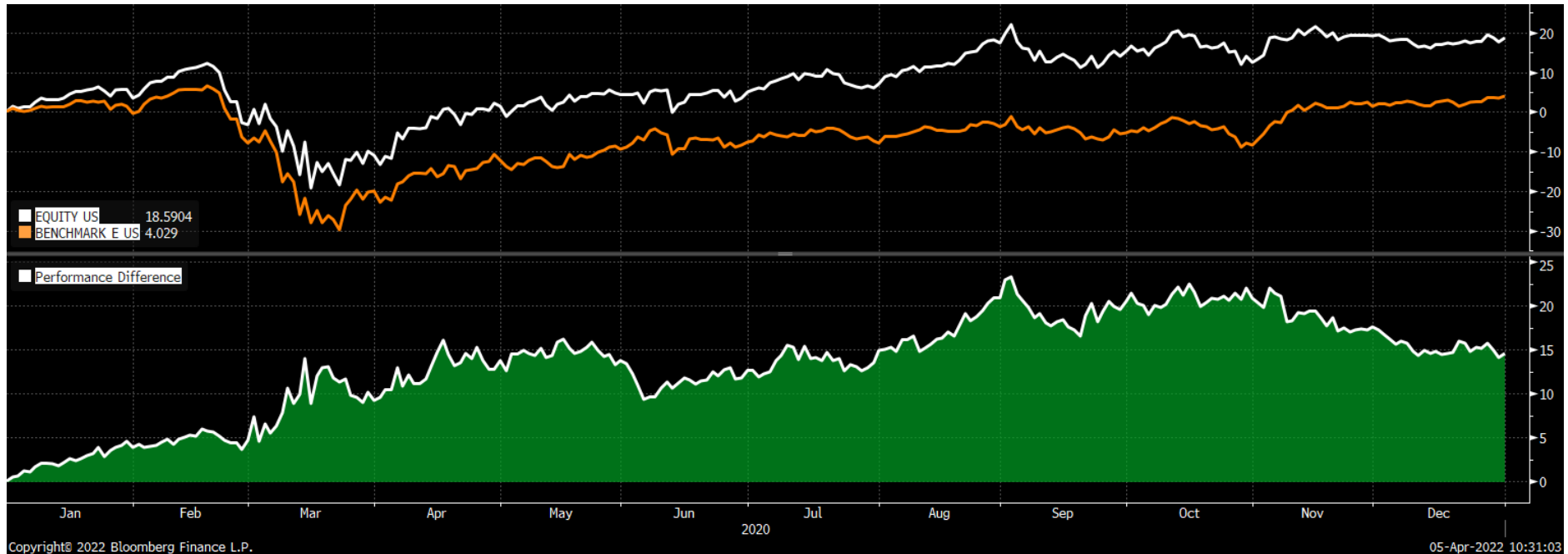
Kumulatívna hrubá priemerná Alpha dosiahla od 1.1.2020 do 31.12.2024 úroveň 10,43%

Vývoj historického simulovaného (od 1.1.2020 do 30.4.2020) a historického (od 1.5.2020 do 31.12.2024) celkového hrubého percentuálneho zhodnotenia portfólia a benchmarku, vývoj parametra „Alpha“ (rozdiel medzi výnosmi portfólia a benchmarku) a zobrazenie celkového výnosu na báze p.a. Všetky výnosy sú prepočítané do meny EUR a sú uvedené pred odrátaním poplatkov, provízií a pred zdanením. Zdroj: autor, Bloomberg Professional Terminal. Zobrazené údaje sa týkajú minulosti. Výkonnosť v minulosti nie je spoľahlivým ukazovateľom budúcich výsledkov. Výnos sa môže zvýšiť alebo znížiť v dôsledku menových výkyvov. Údaje o zhodnotení sú založené na hrubej výkonnosti. Príklad kumulatívneho účinku nákladov na návratnosť investície je uvedený prostredníctvom webového odkazu, ktorý je uvedený na prvej strane tejto správy.



Vývoj hrubého percentuálneho zhodnotenia portfólia za rok 2020

Za obdobie kalendárneho roku 2020 sa hrubá hodnota portfólia na percentuálnej báze zmenila v mene EUR o 18,59%. V porovnaní s benchmarkom vytvorilo portfólio za uvedenú časovú periódu rozdiel vo výnosoch („Alpha“) na úrovni 14,56%.

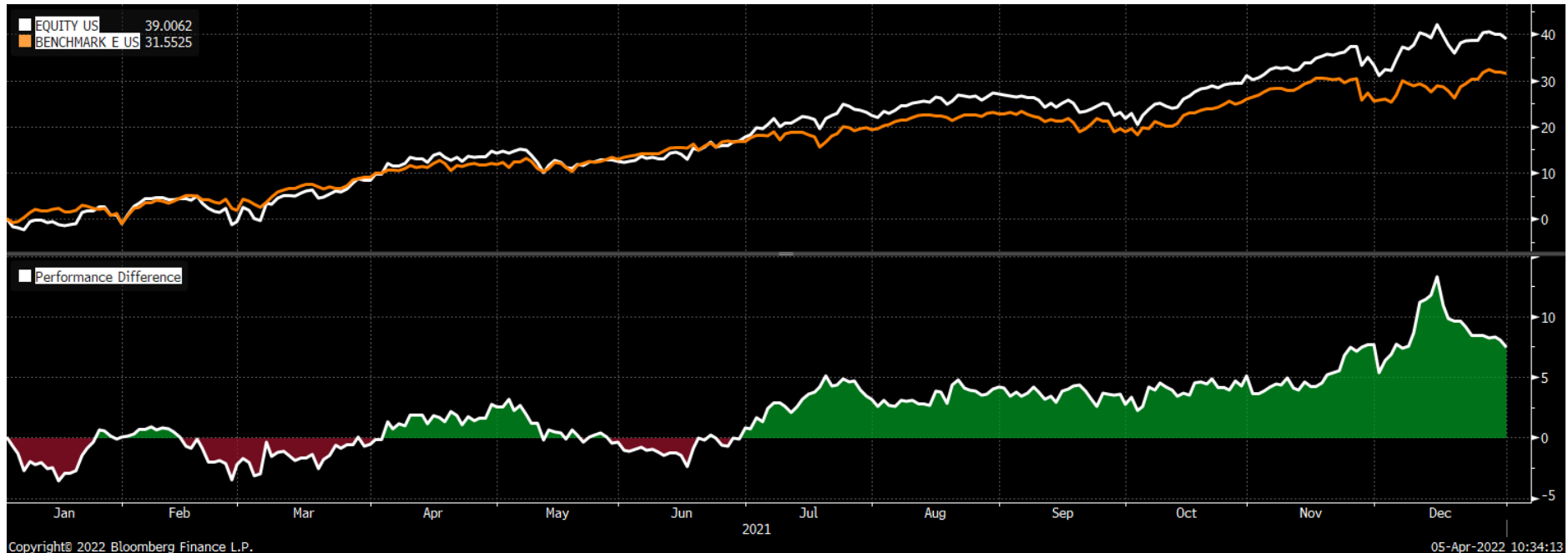


Vývoj historického simulovaného (od 1.1.2020 do 30.4.2020) a historického (od 1.5.2020 do 31.12.2020) celkového hrubého percentuálneho zhodnotenia portfólia a benchmarku a vývoj parametra „Alpha“ (rozdiel medzi výnosmi portfólia a benchmarku) od 1.1.2020 do 31.12.2020; 1.1.2020 = 0%. Všetky výnosy sú prepočítané do meny EUR a sú uvedené pred odrátaním poplatkov, provízií a pred zdanením. Zdroj: autor, Bloomberg Professional Terminal. Zobrazené údaje sa týkajú minulosti. Výkonnosť v minulosti nie je spoľahlivým ukazovateľom budúcich výsledkov. Výnos sa môže zvýšiť alebo znížiť v dôsledku menových výkyvov. Údaje o zhodnotení sú založené na hrubej výkonnosti. Príklad kumulatívneho účinku nákladov na návratnosť investície je uvedený prostredníctvom webového odkazu, ktorý je uvedený na prvej strane tejto správy.



Vývoj hrubého percentuálneho zhodnotenia portfólia za rok 2021

Za obdobie kalendárneho roku 2021 sa hrubá hodnota portfólia na percentuálnej báze zmenila v mene EUR o 39,01%. V porovnaní s benchmarkom vytvorilo portfólio za uvedenú časovú periódu rozdiel vo výnosoch („Alpha“) na úrovni 7,46%.



Vývoj historického celkového hrubého percentuálneho zhodnotenia portfólia a benchmarku a vývoj parametra „Alpha“ (rozdiel medzi výnosmi portfólia a benchmarku) od 1.1.2021 do 31.12.2021; 1.1.2021 = 0%. Všetky výnosy sú prepočítané do meny EUR a sú uvedené pred odrátaním poplatkov, provízií a pred zdanením. Zdroj: autor, Bloomberg Professional Terminal. Zobrazené údaje sa týkajú minulosti. Výkonnosť v minulosti nie je spoľahlivým ukazovateľom budúcich výsledkov. Výnos sa môže zvýšiť alebo znížiť v dôsledku menových výkyvov. Údaje o zhodnotení sú založené na hrubej výkonnosti. Príklad kumulatívneho účinku nákladov na návratnosť investície je uvedený prostredníctvom webového odkazu, ktorý je uvedený na prvej strane tejto správy.



Vývoj hrubého percentuálneho zhodnotenia portfólia za rok 2022

Za obdobie kalendárneho roku 2022 sa hrubá hodnota portfólia na percentuálnej báze zmenila v mene EUR o -10,64%. V porovnaní s benchmarkom vytvorilo portfólio za uvedenú časovú periódu rozdiel vo výnosoch („Alpha“) na úrovni 0,25%.



Vývoj historického celkového hrubého percentuálneho zhodnotenia portfólia a benchmarku a vývoj parametra „Alpha“ (rozdiel medzi výnosmi portfólia a benchmarku) od 1.1.2022 do 31.12.2022; 1.1.2022 = 0%. Všetky výnosy sú prepočítané do meny EUR a sú uvedené pred odrátaním poplatkov, provízií a pred zdanením. Zdroj: autor, Bloomberg Professional Terminal. Zobrazené údaje sa týkajú minulosti. Výkonnosť v minulosti nie je spoľahlivým ukazovateľom budúcich výsledkov. Výnos sa môže zvýšiť alebo znížiť v dôsledku menových výkyvov. Údaje o zhodnotení sú založené na hrubej výkonnosti. Príklad kumulatívneho účinku nákladov na návratnosť investície je uvedený prostredníctvom webového odkazu, ktorý je uvedený na prvej strane tejto správy.



Vývoj hrubého percentuálneho zhodnotenia portfólia za rok 2023

Za obdobie kalendárneho roku 2022 sa hrubá hodnota portfólia na percentuálnej báze zmenila v mene EUR o 29,91%. V porovnaní s benchmarkom vytvorilo portfólio za uvedenú časovú periódu rozdiel vo výnosoch („Alpha“) na úrovni 10,97%.

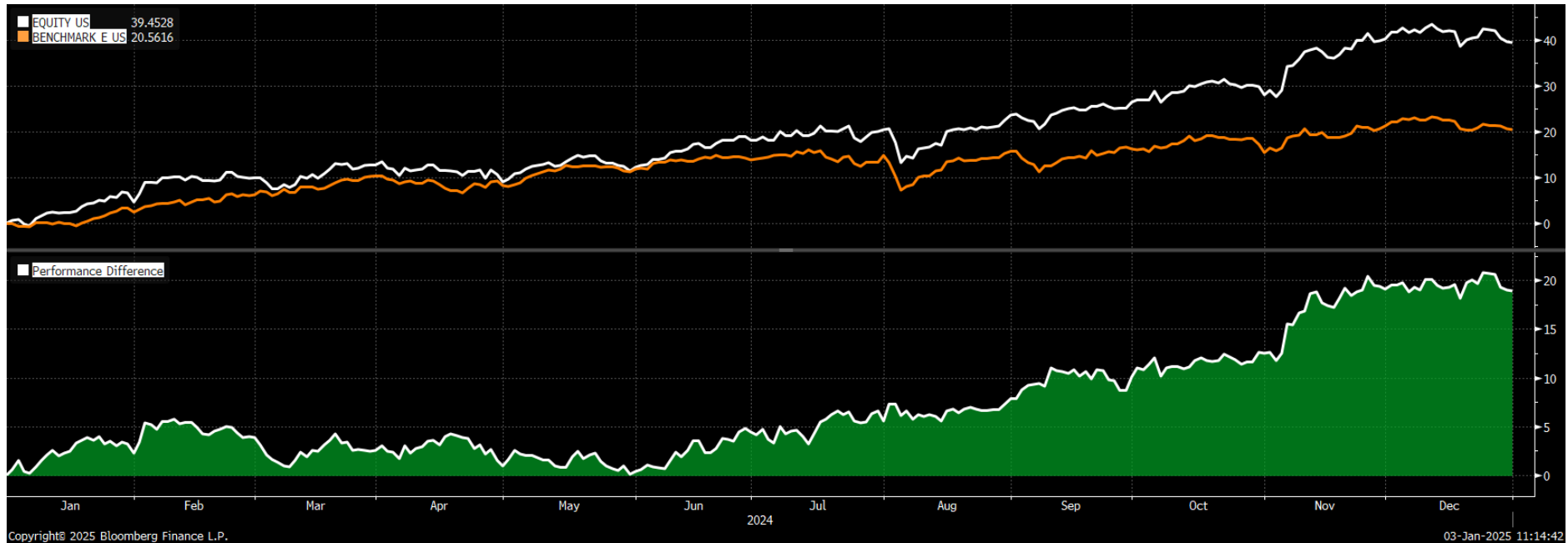


Vývoj historického celkového hrubého percentuálneho zhodnotenia portfólia a benchmarku a vývoj parametra „Alpha“ (rozdiel medzi výnosmi portfólia a benchmarku) od 1.1.2023 do 31.12.2023; 1.1.2023 = 0%. Všetky výnosy sú prepočítané do meny EUR a sú uvedené pred odrátaním poplatkov, provízií a pred zdanením. Zdroj: autor, Bloomberg Professional Terminal. Zobrazené údaje sa týkajú minulosti. Výkonnosť v minulosti nie je spoľahlivým ukazovateľom budúcich výsledkov. Výnos sa môže zvýšiť alebo znížiť v dôsledku menových výkyvov. Údaje o zhodnotení sú založené na hrubej výkonnosti. Príklad kumulatívneho účinku nákladov na návratnosť investície je uvedený prostredníctvom webového odkazu, ktorý je uvedený na prvej strane tejto správy.



Vývoj hrubého percentuálneho zhodnotenia portfólia za rok 2024

Za obdobie od 1.1.2024 do 31.12.2024 sa hrubá hodnota portfólia na percentuálnej báze zmenila v mene EUR o 39,45%. V porovnaní s benchmarkom vytvorilo portfólio za uvedenú časovú periódu rozdiel vo výnosoch („Alpha“) na úrovni 18,89%.



Vývoj historického celkového hrubého percentuálneho zhodnotenia portfólia a benchmarku a vývoj parametra „Alpha“ (rozdiel medzi výnosmi portfólia a benchmarku) od 1.1.2024 do 31.12.2024; 1.1.2024 = 0%. Všetky výnosy sú prepočítané do meny EUR a sú uvedené pred odrátaním poplatkov, provízií a pred zdanením. Zdroj: autor, Bloomberg Professional Terminal. Zobrazené údaje sa týkajú minulosti. Výkonnosť v minulosti nie je spoľahlivým ukazovateľom budúcich výsledkov. Výnos sa môže zvýšiť alebo znížiť v dôsledku menových výkyvov. Údaje o zhodnotení sú založené na hrubej výkonnosti. Príklad kumulatívneho účinku nákladov na návratnosť investície je uvedený prostredníctvom webového odkazu, ktorý je uvedený na prvej strane tejto správy.