

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 Omnium 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.



PERCENTUÁLNE ZHODNOTENIE PORTFÓLIA



Vývoj simulovanej kumulovanej percentuálnej historickej výkonnosti (od 31. 3. 2019 do 31. 12. 2021) a kumulovanej percentuálnej historickej výkonnosti (od 1. 1. 2022 do 31. 3. 2024), 31. 3. 2019 = 0%. Zdroj: Omnium Capital o.c.p., a.s.

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, vplyv poplatkov a provízií na kumulatívnu čistú výkonnosť portfólia je uvedený na nasledovnom webovom odkaze: [Príklady znázorňujúce kumulatívny účinok nákladov na návratnosť investície.](#)

ROZŠÍRENÉ CHARAKTERISTIKY INVESTÍCIE

Mena portfólia:	EUR
Efektivita investície:	Sharpe Ratio 0,93*
Rizikovosť investície:	Štandardná odchýlka 17,82 %* Historical 3 Year Simulation VaR95 1D -1,73**

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 na burze a ktoré vlastní > 1 rok.

VYHODNOTENIE RIZIKOVOSTI INVESTÍCIE



* Počítané na základe simulovanej kumulovanej percentuálnej historickej výkonnosti (od 31. 3. 2019 do 31. 12. 2021) a kumulovanej percentuálnej historickej výkonnosti (od 1. 1. 2022 do 31. 3. 2024), tj. na časovej perióde 1300 obchodných dní počas 5 rokov. Štandardná odchýlka je analizovaná.

** Simulované historické VaR95. Výpočet bol realizovaný 1. 5. 2024. Pri výpočtoch bola využitá metóda: „Historical 3 Year Simulation“, hodnoty sú uvedené už po prerátaní do meny EUR. Zdroj dát: Omnium Capital o.c.p., a.s. VaR95 1D = pravdepodobnosť 95%, že portfólio nevytvorí vyššiu stratu v rámci jedného obchodného dňa, ako je vypočítaná (tj. zo 100 obchodných dní portfólio nevytvorí vyššiu stratu počas 95 dní, vo zvyšných 5 dňoch vypočítaná 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

v: 1-2024



Omniium Capital, o.c.p., a.s.
Potočná 169/85
909 01 Skalica