

METODOLOGIJA IZRAČUNA IN PRIKAZA OBVEZNIH PODATKOV V MESEČNEM POROČILU POSLOVANJA ODPRTEGA INVESTICIJSKEGA SKLADA¹

Grafikon s prikazom VEP sklada

Grafikon prikazuje gibanje VEP odprtega investicijskega sklada v obliki lomljene črte za obdobje zadnjih 36 mesecev njegovega poslovanja oziroma v primeru, ko posluje manj kot 36 mesecev, gibanje VEP v obdobju od njegovega oblikovanja do zadnjega obračunskega dneva preteklega meseca.

Sintetični kazalnik tveganj in donosa

Sintetični kazalnik tveganj in donosa se izračunava mesečno v skladu z metodologijo določeno v Priporočilih ESMA (CESR) glede metodologije za izračun sintetičnega kazalnika tveganj (CESR/10-673 z dne 1.7.2010). Izračun kazalnika temelji na volatilnosti sklada. Kazalnik se izračuna kot anualiziran tedenski standardni odklon donosnosti v zadnjih 5 letih delovanja sklada. Na podlagi dobljenega rezultata se sklad uvrsti v določen rang od 1 do 7 na lestvici tveganja, pri čemer 7 pomeni višje tveganje in potencialno višji donos, 1 pa nižje tveganje in potencialno nižji donos.

Več na: https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/2015/11/10_673.pdf

Kumulativna donosnost

Podatki o kumulativni donosnosti naložbe v enote odprtega investicijskega sklada so izkazani za obdobja zadnjih 12, 36 in 60 mesecev poslovanja odprtega investicijskega sklada. Podatki so navedeni v odstotkih na dve decimalni mesti natančno. Družba za upravljanje ne sme navajati kumulativnih donosnosti za obdobja, krajša od navedenih v prvem stavku tega odstavka.

Deset največjih naložb

Deset največjih naložb odprtega investicijskega sklada je izkazanih po stanju na zadnji obračunski dan meseca, ki je od meseca objave oddaljen največ tri mesece. Podatek obsega ime naložbe in delež naložbe v odstotku od čiste vrednosti sredstev odprtega investicijskega sklada. Ob tem je v tabeli na vidnem mestu naveden tudi obračunski dan (dd.mm.llll), na katerega se podatki nanašajo. Podatek se prvič navaja v mesečnem poročilu, ki sledi 10. mesecu poslovanja odprtega investicijskega sklada.

Sestava naložb

Sestava naložb odprtega investicijskega sklada je izkazana po stanju na zadnji obračunski dan preteklega meseca. Prikazana je v obliki histograma, pri čemer posamezni stolpec predstavlja delež določenega segmenta naložb v čisti vrednosti sredstev. Histogram prikazuje sestavo naložb odprtega investicijskega sklada po kriteriju, ki je glede na njegovo specifično naložbeno usmeritev zanj najbolj reprezentativen. V primeru, da odprt investicijski sklad posluje manj kot 6 mesecev, histogram prikazuje naložbe ločeno po vrstah finančnih instrumentov (depoziti, delnice, obveznice, instrumenti denarnega trga, enote premoženja odprtih investicijskih skladov, izvedeni finančni instrumenti in drugo). Sestava naložb se v mesečnem poročilu od 1. 1. 2013 dalje izračunava glede na delež naložb v čisti vrednosti sredstev sklada, zato je skupna vrednost lahko tudi večja ali manjša od 100 %.

Čista vrednost sredstev

Podatek o čisti vrednosti sredstev je izkazan v evrih po stanju na zadnji obračunski dan preteklega meseca.

¹ Metodologija velja od 14.1.2013 dalje