

## METODOLOGIJA IZRAČUNA PODATKOV, NAVEDENIH V MESEČNEM POROČILU

Metodologija izračuna podatkov, navedenih v poročilih odprtih investicijskih skladov (v nadaljevanju: sklad) v upravljanju družbe ALTA Skladi, družba za upravljanje, d.d., Železna cesta 18, 1000 Ljubljana, v skladu s Sklepom o objavah in neposrednem obveščanju imetnikov enot (Uradni list RS, št. 33/12 s spremembami).

### Grafikon s prikazom gibanja VEP sklada

Grafikon je v obliki lomljene črte in prikazuje gibanje VEP sklada v obdobju 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). Podatki o tveganosti sklada so v mesečnem poročilu o poslovanju sklada navedeni v enakem obsegu in obliki kot velja za dokument s ključnimi podatki za vlagatelje sklada.

Izračun sintetičnega kazalnika tveganj in donosa temelji na volatilnosti (nihajnosti) sklada. Volatilnost je izračunana kot analizirani tedenski standardni odklon donosnosti v zadnjih petih letih poslovanja sklada. Na podlagi dobljenega rezultata se sklad uvrsti v ustrezen rang od 1 do 7 na lestvici tveganja.

### Kumulativna donosnost

Podatki o kumulativni donosnosti naložbe v enote sklada so prikazani za obdobja zadnjih 12, 36 in 60 mesecev poslovanja odprtega sklada. Podatki so navedeni v odstotkih na dve decimalni mesti natančno.

$$PRETEKLA_{donosnost} = \left( \frac{VEP_t}{VEP_{t-n}} - 1 \right) * 100$$

pri čemer je:

t : zadnji obračunski dan v mesecu,

n: ustrezno obdobje (12 mesecev, 36 mesecev, 60 mesecev).

### Deset največjih naložb

Deset največjih naložb sklada je prikazanih po stanju na zadnji obračunski dan meseca, ki je od meseca objave oddaljen največ tri mesece (npr. podatek na zadnji obračunski dan meseca januarja se objavi v mesečnem poročilu, izdanem meseca maja). Podatek obsega ime naložbe in delež naložbe v odstotku od čiste vrednosti sredstev sklada. Obračunski dan (dd.mm.llll), na katerega se podatki nanašajo, je naveden v tabeli na vidnem mestu.

### Sestava naložb sklada

Sestava naložb sklada je prikazana po stanju na zadnji obračunski dan preteklega meseca. Sestava naložb je prikazana v obliki histograma, ki vsebuje tudi deleže (v odstotkih) posameznega segmenta naložb v čisti vrednosti sredstev.

### Čista vrednost sredstev sklada

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