

Metodologija izračuna podatkov

Metodologija izračuna podatkov, navedenih v mesečnih poročilih podskladov
Generali Krovnega sklada

Gibanje VEP (grafikon)

Grafikon prikazuje gibanje VEP odprtega investicijskega sklada v zadnjih 36 mesecih njegovega delovanja. Če je investicijski sklad deloval manj kot 36 mesecev, grafikon prikazuje gibanje VEP od njegove ustanovitve pa do zadnjega obračunskega dneva preteklega meseca. VEP je na grafikonu prikazan v EUR kot lomljena črta.

Zbirni kazalnik tveganja

Zbirni kazalnik tveganja je smernica glede stopnje tveganja sklada v primerjavi z drugimi produkti. Izračunava se mesečno, in sicer v skladu z metodologijo navedeno v Prilogi II k Delegirani uredbi 2017/653/EU.

Zbirni kazalnik tveganja odprtega investicijskega sklada je v mesečnem poročilu o poslovanju odprtega investicijskega sklada prikazan v enakem obsegu in obliki kot je določeno v Prilogi III k Delegirani uredbi 2017/653/EU in Delegirani uredbi Komisije (EU) 2021/2268 z dne 6. septembra 2021 o spremembi regulativnih tehničnih standardov iz Delegirane uredbe Komisije (EU) 2017/653

Več na:

<https://eur-lex.europa.eu/legal-content/SL/TXT/?uri=CELEX%3A32017R0653>

<https://eur-lex.europa.eu/legal-content/SL/TXT/?uri=celex%3A32021R2268>

Podatki o kumulativni donosnosti

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.

Pojasnilo o izračunu preteklih donosov

V mesečnih poročilih so pretekli donosi za posamezen podsklad krovnega sklada izračunani kot sprememba vrednosti enote premoženja (VEP), in sicer med njeno vrednostjo na zadnji obračunski dan meseca, za katerega je poročilo pripravljeno (t), in njeno vrednostjo na zadnji obračunski dan v predhodnem mesecu (t-n).

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

pri čemer je:

t : zadnji obračunski dan v mesecu;

n: ustrezno obdobje (1 leto, 3 leta, 5 let).

VEP sklada po stanju na obračunski dan (t) se izračuna po naslednji formuli:

$$VEP_{(t)} = \frac{S_{(t)} - O_{(t)}}{E_{(t-1)}}$$

pri čemer je:

t-1: predhodni obračunski dan;

t: obračunski dan;

S: sredstva sklada;

O: obveznosti sklada;

E: število enot v obtoku sklada.

Metodologija izračuna povprečne tedenske donosnosti in standardnega odklona tedenske donosnosti

Povprečna tedenska donosnost sklada se izračuna kot aritmetična sredina tedenskih donosnosti v zadnjih 12 mesecih poslovanja sklada. Pri izračunu se upoštevajo vrednosti enote premoženja po stanju na obračunski dan petek. Če vrednost enote premoženja na obračunski dan petek ni bila izračunana, se upošteva vrednost enote premoženja na predhodni obračunski dan.

Sprememba vrednosti enote premoženja sklada (VEP) se izračuna za vsak petek (t) nasproti njeni vrednosti v vsakem predhodnem petku (t-1).

$$SpremembaVEP = \frac{VEP_t}{VEP_{t-1}}$$

Povprečje tedenskih sprememb vrednosti enot premoženja sklada (VEP) se izračuna tako, da se sešteje vse tedenske spremembe in vsoto deli s številom tednov v enem letu (52).

$$PTD = \frac{r_1 + r_2 + \dots + r_{52}}{52}$$

pri čemer je:

PTD: povprečni tedenski donos

r: donos.

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 je prvič naveden 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 (npr. razdelitev naložb po državah oziroma regijah, po gospodarskih sektorjih, po valutah, po vrstah finančnih instrumentov, po ročnosti dolžniških vrednostnih papirjev ipd.). 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 izračunava glede na delež naložb v čisti vrednosti sredstev sklada po konverziji, zato je skupna vrednost lahko tudi večja ali manjša od 100 %.

Podatki o čisti vrednosti sredstev

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

Ljubljana, 30. 11. 2023

Generali Investments, družba za upravljanje, d.o.o.