

Skipper Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap

EUR sorozat



marketpro
Asset Management

ÁLTALÁNOS INFORMÁCIÓK

| | |
|------------------------------------|---------------------------------|
| Alapkezelő: | Marketpro Asset Management Zrt. |
| Letétkezelő: | Erste Bank Hungary Zrt. |
| Vezető forgalmazó: | Marketpro Asset Management Zrt. |
| Benchmark összetétele: | 100% EURIBOR 1M SK |
| ISIN kód: | HU0000719299 |
| Indulás: | 2017.11.27 |
| Devizanem: | EUR |
| A teljes alap nettó eszközértéke: | 1 300 410 EUR |
| EUR sorozat nettó eszközértéke: | 1 132 273 EUR |
| Egy jegyre jutó nettó eszközérték: | 0,009748 EUR |

BEFEKTETÉSI POLITIKA:

A SKIPPER Abszolút Hozamú Származtatott Alap elsődleges célja a kockázatmentes hozamnál magasabb megtérülés elérése hosszú távon többlet kockázatok vállalásával, döntően államkötvény- és devizabefektetések és spekulatív származtatott ügyletek segítségével. Az Alapkezelő az Alap vagyonát abszolút hozamú szemléletben kezeli, megcélözva ezzel a kockázatmentes hozamot meghaladó megtérülést. Az Alapkezelő kiemelt figyelmet fordít a magas szintű és hatékony kockázatkezelésre, a volatilitás elfogadható szinten tartása érdekében. Az alap a jogszabályban meghatározott limitek és szorzószámok figyelembe vételével tőkeáttételes, hosszú (vételi) és fedezetlen rövid (eladási) pozíciókat is felvehet. Az Alap összetételének kialakítása során az Alapkezelő dinamikusan alakítja ki a különböző eszközcsoportok súlyát a piaci helyzet és a követett stratégia függvényében. Az Alapkezelő a fundamentális elemzések mellett kiemelt figyelmet fordít a piaci hangulat ingadozására, és a technikai elemzés eszközeit is használja a piacra lépés időzítésekor. Az Alap befektetéseinek fókuszja a fejlődő országok államkötvény- és devizapiacai és azok derivatív piacainak kibocsátói. Ugyanakkor az Alap a globális piacokon (kötvény, nyersanyag, részvény, stb.) is széles körben fektethet kedvezőnek ítélt befektetési lehetőségekbe. A referenciahozam a 1 hónapos EURIBOR Fixing éves számtani átlaga (Bloomberg). Az Alap nem rendelkezik előre meghatározott földrajzi vagy szektorális megkötéssel.

FORGALMAZÓK

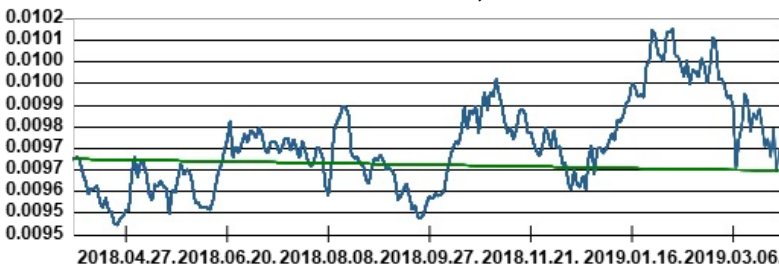
Marketpro Asset Management Zrt.

AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

| Időtáv | Befektetési jegy | Benchmark |
|------------|------------------|-----------|
| indulástól | -1,89 % | -0,37 % |
| 2018 | -2,16 % | -0,37 % |

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2018.04.01 - 2019.03.31



— Skipper Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap EUR sorozat

— Benchmark

A múltbéli hozamok nem jelentenek garanciát az alap jövőbeli teljesítményére nézve. Jelen hirdetés nem minősül ajánlattételnek vagy befektetési tanácsadásnak. A befektetés részletes feltételeit az Alap Tájékoztatója tartalmazza, mely a mindenkor érvényes kondíciós listákkal együtt megtalálható a forgalmazási helyeken. A befektetési alap forgalmazásával (vétel, tartás, eladás) kapcsolatos költségek az alap kezelési szabályzatában és a forgalmazási helyeken megismerhetők.

KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 6,51 %

A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,01 %

PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

Az alapnak a hónapban a román kamatpiacon volt kitétsége. Emellett az EURUSD, EURRON és az EURHUF devizapárban kereskedett.

A március hónap a szokottnál nagyobb volatilitást hozott a fejlődő piacokon. A török önkormányzati választások miatt a török jegybank valószínűleg támogatta a líra árfolyamát, aminek következtében tovább apadtak az egyébként is alacson szinten álló tartalékok. Sőt a választások előtti napokban az árfolyam védelmében az egekbe kényszerítette a rövid kamatokot a jegybank, ami sokat rombolt a külföldi befektetők megítélésén.

A megnövekedett volatilitás miatt csökkentettük az alap fejlődő piaci brazil és mexikói kitétségét, hogy az alap célvolatilitása továbbra is a célnak kitűzött 10% körül maradjon. A hónapban lezártuk a kínai részvénypozíciókat és új kitétségeket vásároltunk nemesfémekben. A laza monetáris politikák és a lassuló gazdasági teljesítmény mellett a nemesfémek jó teljesítményére számítunk.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉLE 2019.03.31

| Eszköz típusa | Részarány |
|--------------------------------------|-----------|
| Kollektív értékpapírok | 17,40 % |
| Államkötvények | 16,34 % |
| Vállalati és hitelintézeti kötvények | 4,41 % |
| Számlapénz | 64,72 % |
| Kötelezettség | -29,19 % |
| Követelés | 29,13 % |
| Nyitott derivatív pozíciók értéke | -2,23 % |
| Összesen | 100,00 % |
| Származtatott ügyletek | 297,55 % |
| Nettó korrekciós tőkeáttétel | 189,98 % |

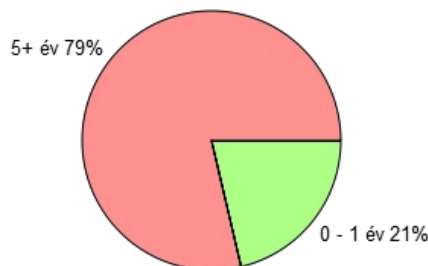
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

TURKGB 10,5 08/11/27 (Török Állam)
Silver US Equity
Gold US Equity
EBRD 27,5 10/02/19 (Egyesült Királyság)
VENZ 7,65 4/21/25 (Venezuelai Állam)

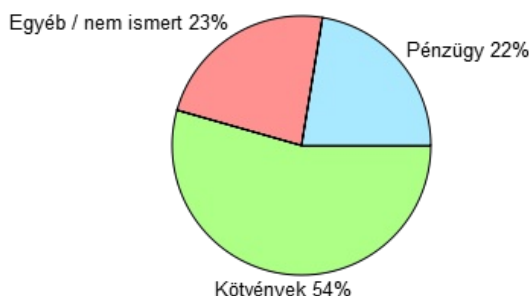
10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

TURKGB 10,5 08/11/27 (Török Állam)

Lejárat szerinti megoszlás:



A részvények szektoronkénti megoszlása:



BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszaki szórása alapján:

