

Skipper Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap EUR sorozat



marketprog
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:	1 306 708 EUR
EUR sorozat nettó eszközértéke:	1 140 270 EUR
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	0,009817 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, megcélozva 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 befektetései fókuszban 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	-1,10 %	-0,37 %
2018	-2,16 %	-0,37 %

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2018.08.01 - 2019.07.31



— Skipper Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap EUR sorozat

— Benchmark

A múltbeli 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: 8,00 %

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

PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

A hónap során a kedvező árfolyammozgások miatt az alap csökkentette HUF devizával szembeni kitétségét és az alap török pozíciójának mérete is csökkent. A kockázatok Törökországban növekedtek, de a kedvező nemzetközi környezet továbbra is támogató a kockázatos eszközök árfolyamára.

Az alap július elején kismértékben növelte nemesfém kitétségét.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2019.07.31

Eszköz típusa	Részarány
Kollektív értékpapírok	21,64 %
Államkötvények	20,86 %
Számlapénz	64,53 %
Kötelezettség	-0,61 %
Követelés	0,29 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	-6,25 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	267,02 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	183,30 %

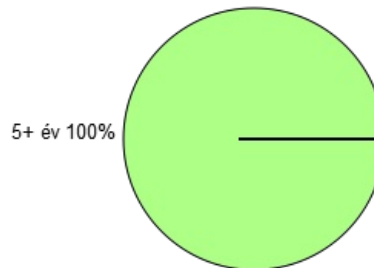
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

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

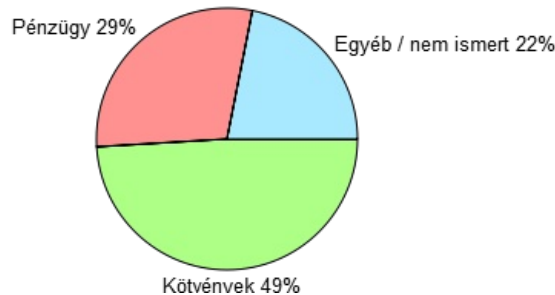
10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

TURKGB 10,5 08/11/27 (Török Állam)
Gold US Equity

Lejárat szerinti megoszlás:



A részvények szektoronkénti megoszlása:



BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszaki szórása alapján:



nagyon alacsony alacsony mérsékelt közepes **jelentős** magas nagyon magas