

# Skipper Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap EUR sorozat



## ÁLTALÁNOS INFORMÁCIÓK

Alapkezelő: Marketpro Asset Management Zrt.  
 Letétkezelő: UniCredit Bank 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: 1 332 521 EUR  
 EUR sorozat nettó eszközértéke: 1 320 090 EUR  
 Egy jegyre jutó nettó eszközérték 0,009767 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, megelőzve 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 piaca lépés időzítésekor. Az Alap befektetéseknek fókuszja a fejlődő országok államkötvény- és devizapiacai és azok derivatív piacainak kibocsátói. Ugyanakkor az Alap a globális piacokon (hőtvény, nyersanyag, részvény, stb.) is széles körben fektethet kedvezőnek ítélt befektetési lehetőségekre. 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.

## BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszaki szórása alapján:



## PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

Az alapnak a hónapban a román deviza és kamatpiacon volt kitétsége. Emellett az EURUSD devizapárban vett fel pozíciót. Az áru piacokon az alap aktív volt az olaj, a réz és az ezüst piacán is. A fejlődő piacokon több egyedi jó befektetési lehetőség mutatkozik de a dollár erősödése, a kínai gazdaság lassulása és a kereskedelmi háború fokozódása mind negatívan befolyásolja a fejlődő piaci devizák és hőtvények klátásait. Ezért a globális béta kockázat miatt a fejlődő piacok risk/return klátásai nem egyértelműen pozitívak

## AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2018.06.30

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	13,04 %
Számlapénz	86,13 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	0,57 %
Kötelezettség	-0,23 %
Követelés	0,02 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	214,69 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	160,79 %

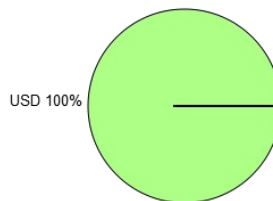
## A(z) 5 legnagyobb pozíció:

REPHUN 2019/03/25 4% USD (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

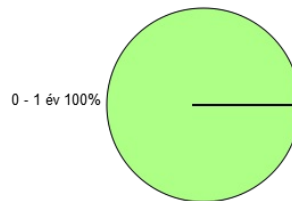
## 10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

REPHUN 2019/03/25 4% USD (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

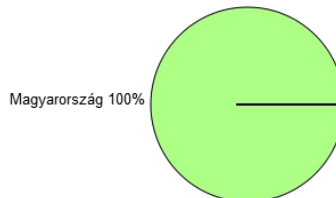
## Devizánkénti megoszlás:



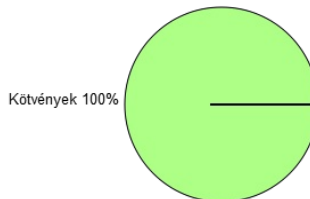
## Lejárat szerinti megoszlás:



## A részvények országonkénti megoszlása:



## A részvények szektoronkénti megoszlása:



## AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	-2,33 %	-0,22 %
1 hónap	0,87 %	-0,03 %
3 hónap	0,03 %	-0,09 %
6 hónap	-2,00 %	-0,19 %

## AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

### EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2017.11.27 - 2018.06.30



— 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: 3,78 %  
 A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,01 %