

Skipper Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap EUR sorozat



ÁLTALÁNOS INFORMÁCIÓK

Alapkezelő:	Marketpro Asset Management Zrt.
Letétkezelő:	Erste Bank Hungary Zrt.
Vezető forgalmazó:	Marketpro Asset Management Zrt.
Benchmark összetétele:	100% EURIBOR 1MSK
ISIN kód:	HU0000719299
Indulás:	2017.11.27
Devizanem:	EUR
A teljes alap nettó eszközértéke:	1 278 089 EUR
EUR sorozat nettó eszközértéke:	1 114 190 EUR
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	0,009592 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 vagy onát 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 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 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 időszakai szórása alapján:



PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

Az alapnak a hónapban a román deviza és kamatpiacon volt kitettsége. Emellett az EURUSD és az EURHUF devizapárban kereskedett. Az áru piacokon az alap aktív volt a réz és az arany piacán is.

A fejlődő piacokkal kapcsolatban sokkal pozitívabb a véleményünk. Az argentin IMF csomag növelése, a masszív török kamatemelés stabilizálta a két legkockázatosabb piacot. Az értékelési szintek is nagyon kedvezőek a kockázatok tekintve. Az alap tovább növelte a brazil pozícióját és új venezuelai és török kitettségeket vásárolt a hónap folyamán.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2018.09.30

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	13,51 %
Vállalati és hitelintézeti kötvények	3,61 %
Számlapénz	84,56 %
Kötelezettség	-0,32 %
Követelés	0,22 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	-1,50 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	264,60 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	175,20 %

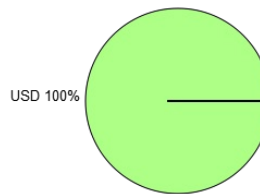
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

REPHUN 2019/03/25 4% USD (Államodosságg Kezelő Központ Zrt.)
 VENZ 7,65 4/21/25 (Venezuelai Állam)

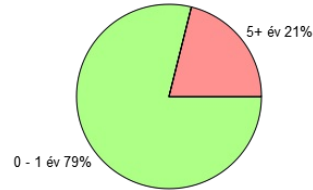
10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

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

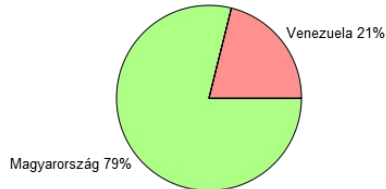
Devizánkénti megoszlás:



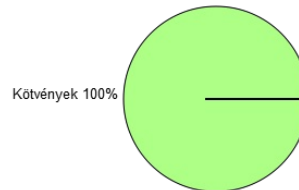
Lejárat szerinti megoszlás:



Arészvények országonkénti megoszlása:



Arészvények szektoronkénti megoszlása:

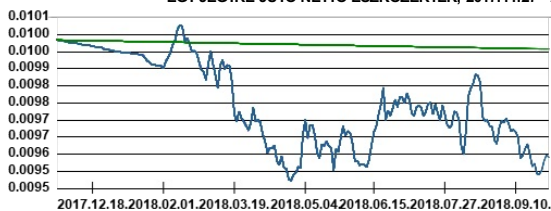


AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	-4,08 %	-0,31 %
1 hónap	-1,32 %	-0,03 %
3 hónap	-1,79 %	-0,09 %
6 hónap	-1,76 %	-0,19 %

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2017.11.27 - 2018.09.30



--- 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: 4,59 %

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