

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:	1 331 736 EUR
EUR sorozat nettó eszközértéke:	1 157 613 EUR
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	0,009966 EUR

BEFETETÉSI 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	-0,27 %	-0,37 %
2018	-2,16 %	-0,37 %

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2018.03.01 - 2019.02.28



— 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: 6,38 %
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 fejlődő piacokkal kapcsolatban továbbra is pozitív a véleményünk. Bár a fejlett és a kínai gazdaság további lassulása várható, ami általában nem kedvez a fejlődő piacok teljesítményének, ugyanakkor számíthatunk a kínai lazítás folytatására és a fejlett piaci jegybankok kevésbé szigorú politikájára is. Az alap brazil, mexikói, török és venezuelai kitétséget tartott a portfólióban, a hónap során a török kitéttesség kismértékben növekedett. Az alap ugyancsak tartott kínai részvénypiaci index pozíciót.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2019.02.28

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	27,35 %
Kollektív értékpapírok	14,48 %
Vállalati és hitelintézeti kötvények	8,38 %
Számlapénz	56,06 %
Kötelezettség	-3,71 %
Követelés	1,54 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	-3,45 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	325,79 %
Nettó korekciós tőkeáttétel	171,52 %

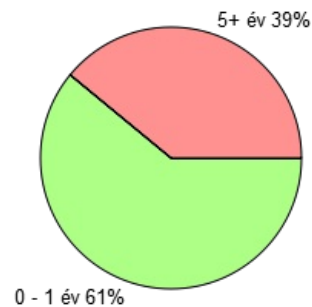
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

Xtrackers Harvest CSI 300 China A ETF
REPHUN 2019/03/25 4% USD (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
TURKGB 10,5 08/11/27 (Török Állam)
EBRD 27,5 10/02/19 (Egyesült Királyság)
VENZ 7,65 4/21/25 (Venezuelai Állam)

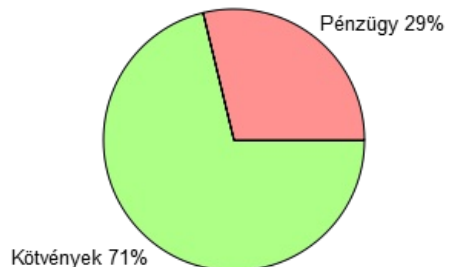
10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

Xtrackers Harvest CSI 300 China A ETF
REPHUN 2019/03/25 4% USD (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

Lejárat szerinti megoszlás:



A részvények szektoronkénti megoszlása:



BEFETETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszaki szórása alapján:

