

# Skipper Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap

## HUF sorozat



### ÁLTALÁNOS INFORMÁCIÓK

Alapkezelő:	Marketpro Asset Management Zrt.
Letétkezelő:	UniCredit Bank Zrt.
Vezető forgalmazó:	Marketpro Asset Management Zrt.
Benchmark összetétele:	100% ZMAX Index
ISIN kód:	HU0000719315
Indulás:	2018.04.12
Devizanem:	HUF
A teljes alap nettó eszközértéke:	1 322 851 EUR
HUF sorozat nettó eszközértéke:	4 057 141 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,007891 HUF

### 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 befektetéseinek 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 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.

### 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 és az EURHUF devizapárban vett fel pozíciót. Az áruiparokban az alap aktív volt a réz és az ezüst piacán. 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 kötvények klátásait. Ezért a globális béta kockázat miatt a fejlődő piacok risk/return klátásai nem egyértelműen pozitívak

### AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2018.07.31

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	13,18 %
Számlapénz	87,13 %
Követelés	0,06 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	-0,20 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	282,17 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	170,78 %

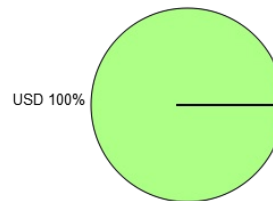
### A(z) 5 legnagyobb pozíció:

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

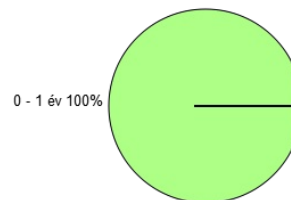
### 10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

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

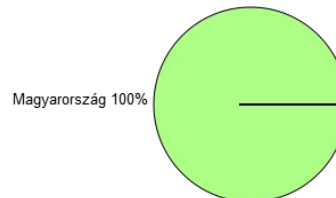
### Devizánkénti megoszlás:



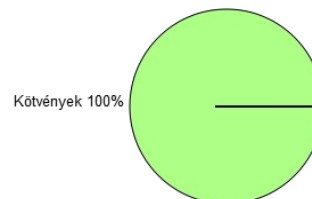
### Lejárat szerinti megoszlás:



### A részvények országonkénti megoszlása:



### A részvények szektoronkénti megoszlása:



### AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	0,79 %	0,02 %
1 hónap	-0,68 %	0,02 %
3 hónap	1,34 %	0,03 %

### AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

#### EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2018.04.12 - 2018.07.31



— Skipper Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap HUF 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: 2,40 %  
A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,03 %