

# Skipper Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap

## EUR sorozat



**marketprog**  
Asset Management

### ÁLTALÁNOS INFORMÁCIÓK

Alapkezelő:	Marketpro Asset Management Zrt.
Letétkezelő:	Unicredit Bank Zrt.
Vezető forgalmazó:	Marketpro Asset Management Zrt.
Benchmark összetétele:	100% EURIBOR 1M
ISIN kód:	HU0000719299
Indulás:	2017.11.27
Devizanem:	EUR
A teljes alap nettó eszközértéke:	1 321 438 EUR
EUR sorozat nettó eszközértéke:	1 308 737 EUR
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	0,009683 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, 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

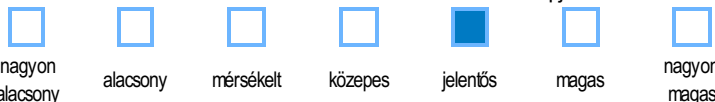
Marketpro Asset Management Zrt.

### BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszakai szórása alapján:



### PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

Az alapnak a hónapban a román, magyar deviza és kamatpiacon volt kitétsége. Emellett a német 10 éves kötvény és az EURUSD devizapárban vett fel pozíciót. Az áru piacokon az alap aktív volt az olaj és a réz piacán is.

### AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2018.05.31

Eszköz típusa	Részarány
Számlapénz	100,18 %
Kötelezettség	-0,75 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	0,50 %
Követelés	0,28 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	232,89 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	176,97 %

### 10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

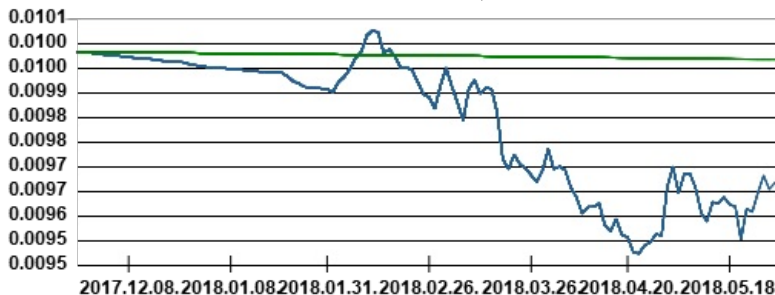
Nincs ilyen eszköz a portfólióban

### AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	-3,17 %	-0,19 %
1 hónap	1,31 %	-0,03 %
3 hónap	-2,37 %	-0,09 %
6 hónap	-3,13 %	-0,18 %

### AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

#### EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2017.11.27 - 2018.05.31



— 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: 3,32 %

A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,00 %