

NETA US Algorithm

Mjesečni Izvještaj 30.11.2015



Kretanje cijene udjela u posljednjih 5 godina



Podaci o prinosu

Ove godine	-8,28%
Posljednjih 12 mj.	-7,39%
*PGP od osnutka	6,66%
2014	11,58%
2013	28,71%
2012	0,21%
2011	-18,30%
2010	32,34%

*prosječni godišnji prinos

Osnovne informacije o fondu

Društvo za upravljanje	Alpen Invest d.d.
Naziv fonda	NETA US Algorithm
Vrsta fonda	Dionički
Iznos minimalne uplate	350,00 kn
Datum početka rada	9.10.2008
Početna vrijednost udjela	100,00
Valuta	HRK
Neto vrijednost imovine	17.059.648,01 kn
Cijena udjela	158,48
Naziv depozitara	SG - Splitska banka d.d.

Deset najvećih pozicija

Oznaka	Naziv	Udio
NCCASH CZ Equity	NETA Multicash	7,85%
NILE US Equity	BLUE NILE INC	4,08%
ABC US Equity	AMERISOURCEBERGEN CORP	3,68%
NAT US Equity	NORDICAMERICAN TANKERS LTD	3,61%
YRCW US Equity	YRC WORLDWIDE INC	3,51%
TXMD US Equity	THERAPEUTICSMD INC	3,42%
PCG US Equity	P G & E CORP	3,06%
CAH US Equity	CARDINAL HEALTH INC	3,00%
REX US Equity	REX AMERICAN RESOURCES CORP	2,85%
GLW US Equity	CORNING INC	2,67%

Papiri vrednovani metodom procjene

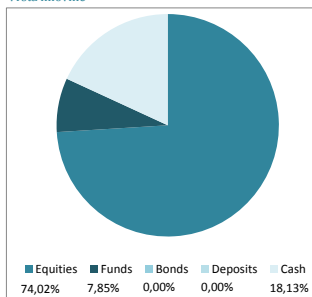
U portfelju nema vrijednosnih papira koji su vrednovani metodom procjene

Podaci o nevrštenim i nedavno izdanim vrijednosnim papirima

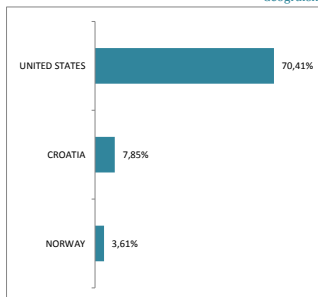
U portfelju nema nevrštenih i nedavno izdanih vrijednosnih papira.

Struktura imovine

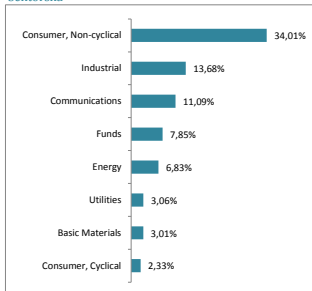
Vrsta imovine



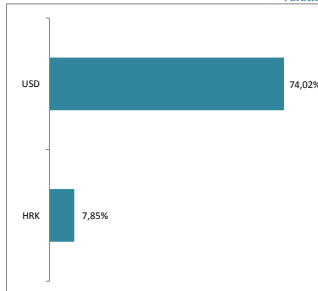
Geografska



Sektorska



Valutna



Ulagateljski ciljevi i strategija ulaganja

Traženje prinosa iznad benchmark indeksa korištenjem punog potencijala algoritamskih sustava. Algoritamski sustavi su temeljeni na postavkama biheioralnih financija i matematičkim modelima koji su prevedeni u programski kod, inicijalno testirani na velikim uzorcima i različitim tržišnim uvjetima, a zatim i u realnom vremenu. Osnovne prednosti su eliminacija subjektivnosti koja je karakteristična za sve konvencionalne metode ulaganja, te mogućnost svakodnevnog analiziranja i filtriranja preko 10.000 vrijednosnih papira koji kotiraju na tržištima Sjedinjenih Američkih Država i Kanade.

Naknade

Ulazna naknada	do 300.000,00 kn 2,00%
	300.000,01 - 500.000,00 kn 1,00%
	500.000,01 - 1.000.000,00 kn 0,50%
	više od 1.000.000,01 kn 0,00%

Izlazna naknada	do 6 mjeseci 0,50%
	više od 6 mjeseci 0,00%
	za iznose više od 500.000,00 kn 0,00%

Upravljačka naknada	3,00%
Naknada depozitaru	0,1400%

Napomena

Do 30. travnja 2010. godine ime ovog fonda bilo je Aureus US Equity i njime je upravljalo društvo Aureus Invest. Pripajanjem Aureus Investa tadašnjem NFD Kapitalu preuzeto je i upravljanje nad fondom te mu je temeljem odobrenja Hanfe od 4. studenog 2010. promijenjen Prospekt, Statut te ime fonda u NFD Aureus US Algorithm. U lipnju 2013. ime fonda primijenjeno je u NETA US Algorithm.

Informacije u ovom dokumentu

Prikazane informacije o prinosu fonda ostvarene u proteklim razdobljima ne predstavljaju indicaciju i nemaju nikakav utjecaj na buduće rezultate poslovanja fonda.

Alpen Invest, d.d.

društvo za upravljanje investicijskim fondovima
Trdinova 4, 1000 Ljubljana
Besplatni info telefon: 0800 6336
www.alpeninvest.hr, info@alpeninvest.com

Godišnji prinos izračunava se kao postotna promjena cijene fonda u odnosu na isto razdoblje prethodne godine. Prinos ove godine predstavlja prinos koji je fond ostvario od početka tekuće godine, a izračunava se kao postotna promjena cijene fonda u odnosu na kraj prethodne godine; prinos posljednjih 12 mjeseci izračunava se analogno kao prinos ove godine ali se odnosi na isti dan prethodne godine. Prosječni godišnji prinos predstavlja prosječni prinos ostvaren na godišnjoj razini koji je fond ostvario od osnivanja, a izračunava se kao geometrijski prosjek prinosa u razdoblju. Prinos je izražen nakon odbitka svih troškova fonda osim mogućih ulaznih i izlaznih naknada. Prinosi iz prošlosti imaju samo informativni karakter, ne predstavljaju indicaciju i nemaju nikakav utjecaj na buduće rezultate poslovanja fonda.