

# NETA US Algorithm

Mjesečni izvještaj 30.9.2015



## Kretanje cijene udjela u posljednjih 5 godina



## Podaci o prinosu

Ove godine	<b>-16,09%</b>
Posljednjih 12 mj.	<b>-9,84%</b>
*PGP od osnutka	5,47%
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	15.802.036,73 kn
Cijena udjela	144,99
Naziv depozitara	SG - Splitska banka d.d.

## Ulagateljski ciljevi i strategija ulaganja

Traženje prinosa iznad benchmark indeksa korištenjem punog potencijala algoritamskih sustava. Algoritamski sustavi su temeljeni na postavkama bihevioralnih 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.

## Deset najvećih pozicija

Oznaka	Naziv	Udio
NCCASH CZ Equity	NETA Multicash	8,46%
EROS US Equity	EROS INTERNATIONAL PLC	4,68%
PSEM US Equity	PERICOM SEMICONDUCTOR CORP	4,17%
NAT US Equity	NORDIC AMERICAN TANKERS LTD	3,78%
NILE US Equity	BLUE NILE INC	3,82%
ABC US EQUITY	AMERISOURCEBERGEN CORP	3,61%
BBSI US Equity	BARRETT BUSINESS SVCS INC	3,61%
PCG US Equity	P G & E CORP	3,12%
LRN US Equity	K12 INC	2,74%
YRCW US Equity	YRC WORLDWIDE INC	2,80%

## 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.

## 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%

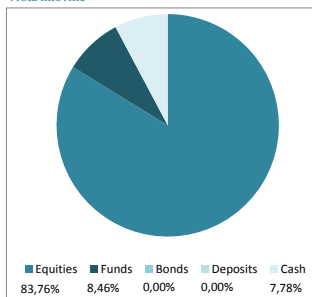
Upravljačka naknada	3,00%
Naknada depozitaru	0,140%

## Napomena

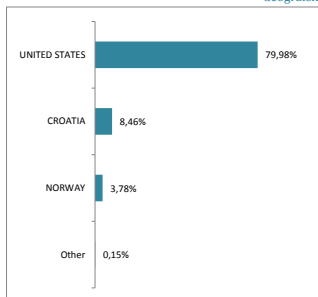
Do 30. travnja 2010. godine ime ovog fonda bilo je Aureus US Equity i njime je upravljalo društvo Aureus Invest. Pripajanjem Aureus Investa tadašnjem NFD Kapitalu preuzeto je i upravljanje nad fondom te mu je temeljem odobrenja Hanfe od 4. studenog 2010. promijenjen Prospekt, Statut te ime fonda u NFD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

## Struktura imovine

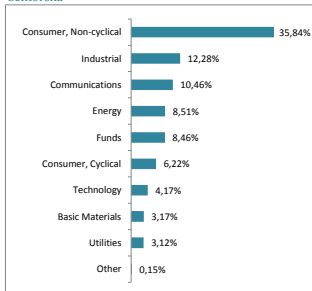
### Vrsta imovine



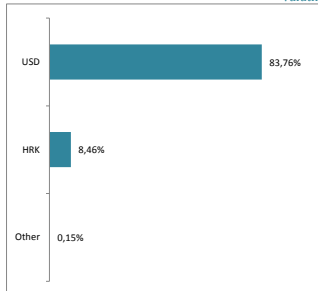
### Geografska



## Sektorska



## Valutna



## 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](http://www.alpeninvest.hr), [info@alpeninvest.com](mailto: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.