

NFD Aureus US Algorithm

Mjesečni izvještaj - 31.12.2010



NFD AUREUS

Invest

Kretanje vrijednosti NAV-a



	Fond	Benchmark
Od početka	46,96%	52,17%
Ove godine	32,34%	37,10%
Ovaj mjesec	7,58%	6,73%
1 godina	32,34%	37,10%
6 mjeseci	36,10%	24,33%
3 mjeseca	27,28%	20,25%
1 mjesec	4,31%	3,02%
1 tjedan	-0,73%	-1,96%

Fond vs. Benchmark

Od početka	-5,21%
Ove godine	-4,76%
Ovaj mjesec	0,85%
6 mjeseci	11,77%
3 mjeseca	7,03%

Osnovni podaci o fondu

Ime	NFD Aureus US Algorithm
Vrsta	Dionički
Rizik	Visoki
Benchmark	Russell 2000
Početak rada	08.10.2008
Valuta	HRK
Neto imovina	23.479.379,31 kn
Vrijednost udjela	146,9593 kn

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.

Top 10 pozicija fonda

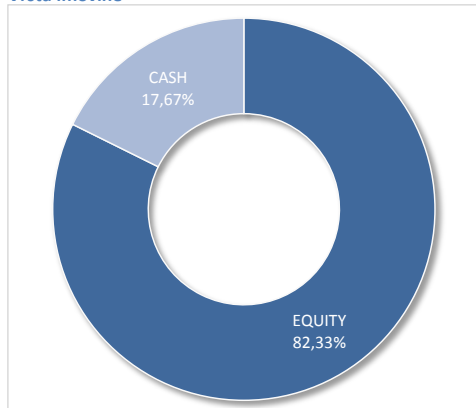
Oznaka	Ime	Zemlja	Sektor	Udio
EXEL US Equity	EXELIXIS INC	UNITED STATES	Consumer, Non-cyclical	4,00%
HDY US Equity	HYPERDYNAMICS CORP	UNITED STATES	Energy	3,99%
DAKT US Equity	DAKTRONICS INC	UNITED STATES	Industrial	3,81%
CBPO US Equity	CHINA BIOLOGIC PRODUCTS INC	CHINA	Consumer, Non-cyclical	3,17%
ISYS US Equity	INTEGRAL SYSTEMS INC/MD	UNITED STATES	Technology	2,81%
BOOM US Equity	DYNAMIC MATERIALS CORP	UNITED STATES	Industrial	2,74%
URRE US Equity	URANIUM RESOURCES INC	UNITED STATES	Basic Materials	2,62%
DY US Equity	DYCOM INDUSTRIES INC	UNITED STATES	Industrial	2,53%
XIDE US Equity	EXIDE TECHNOLOGIES	UNITED STATES	Consumer, Cyclical	2,52%
EROE US Equity	EAGLE ROCK ENERGY PARTNERS	UNITED STATES	Energy	2,51%
SRZ US Equity	SUNRISE SENIOR LIVING INC	UNITED STATES	Consumer, Non-cyclical	2,47%

Sažetak investicijske politike fonda

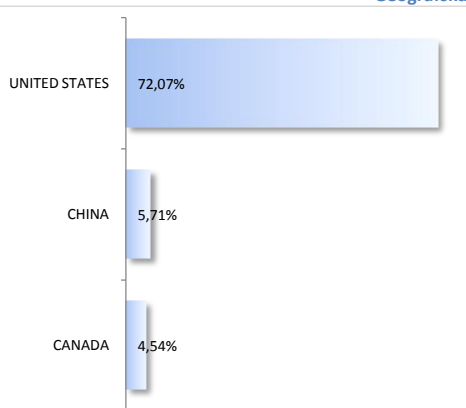
Traženje prinosa iznad benchmark indeksa korištenjem punog potencijala algoritamskih sustava. Algoritamski sustavi su temeljeni na postavkama bihevioralnih financija i matematičkim modelima koji su prevedeni u programski kod, inicijalno testirani na velikim uzorcima i različitim tržišnim uvjetima, a 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.

Pregled izloženosti fonda

Vrsta imovine



Geografska



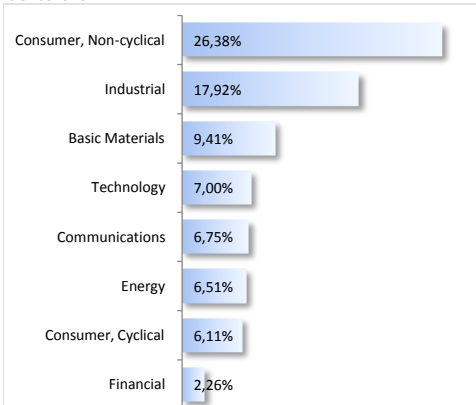
Izloženost fonda

Vrsta imovine	minimalno 70% imovine u dionice
Geografska	SAD
Sektorska	Bez ograničenja
Kapitalizacija	Bez ograničenja
Izdavatelji	max 10% pojedinačnom izdavatelju

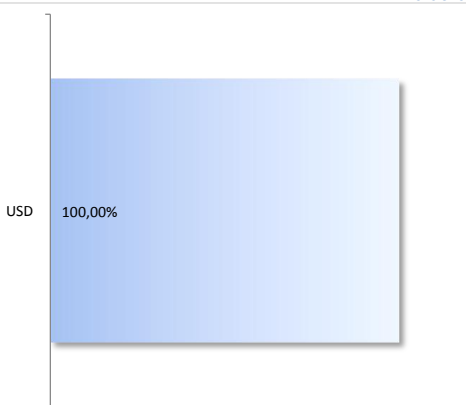
Najmanja uplata, naknade i ostalo

Najmanja uplata	350,00 kn
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%
Skrbnička banka	Societe Generale - Splitska banka

Sektorska



Valutna



NFD Aureus Invest d.d.

društvo za upravljanje investicijskim fondovima
Ilica 1a, 10000 Zagreb

Napomena

Prinosi iz prošlosti informativnog su karaktera i ne predstavljaju indicaciju mogućih prinosa u budućnosti. Prije svakog ulaganja potrebno je proučiti prospekt i statut fonda u koji se ulaže.