

NFD Aureus US Algorithm

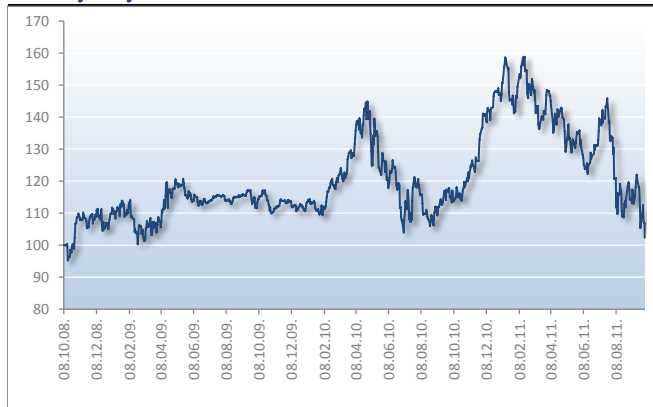
Mjesečni izvještaj - 30.09.2011.



NFD AUREUS

Invest

Kretanje vrijednosti NAV-a



	Fond	Benchmark
Od početka	2,37%	23,41%
Ove godine	-30,34%	-18,90%
Ovaj mjesec	-14,43%	-6,07%
1 godina	-11,11%	-2,38%
6 mjeseci	-30,88%	-19,43%
3 mjeseca	-22,01%	-17,43%
1 mjesec	-14,43%	-6,07%
1 tjedan	-4,66%	-2,28%

Fond vs. Benchmark

Od početka	-21,05%
Ove godine	-11,45%
Ovaj mjesec	-8,36%
6 mjeseci	-11,45%
3 mjeseca	-4,58%

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	17.617.679,12 kn
Vrijednost udjela	102,3658 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

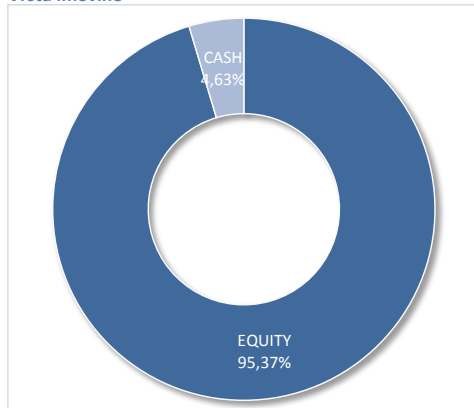
Oznaka	Ime	Zemlja	Sektor	Udio
WCRX US Equity	WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	IRELAND	Consumer, Non-cyclical	4,90%
GOOG US Equity	GOOGLE INC-CL A	UNITED STATES	Communications	4,82%
AAPL US Equity	APPLE INC	UNITED STATES	Technology	4,76%
TMO US Equity	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	UNITED STATES	Industrial	4,74%
BLK US Equity	BLACKROCK INC	UNITED STATES	Financial	4,61%
HAL US Equity	HALLIBURTON CO	UNITED STATES	Energy	4,28%
JPM US Equity	JPMORGAN CHASE & CO	UNITED STATES	Financial	4,23%
CVC US Equity	CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	UNITED STATES	Communications	4,17%
PXD US Equity	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	UNITED STATES	Energy	4,10%
CMI US Equity	CUMMINS INC	UNITED STATES	Industrial	4,07%
WDC US Equity	WESTERN DIGITAL CORP	UNITED STATES	Technology	4,01%

Sažetak investicijske politike fonda

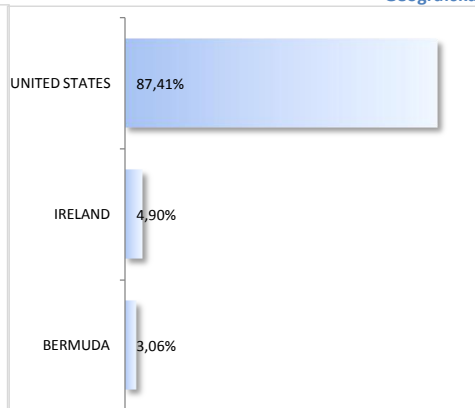
Traženje prinosa iznad benchmark indeksa korištenjem punog potencijala algoritamskih sustava. Algoritamski sustavi su temeljeni na postavkama bihevioralnih financija i matematičkim modelima koji su prevedeni u programski kod, inicijalno testirani na velikim uzorcima i različitim tržišnim uvjetima, a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



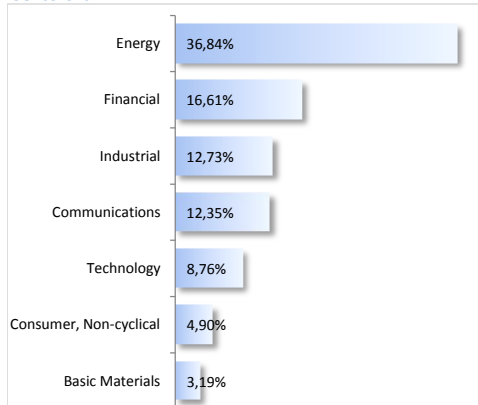
Geografska



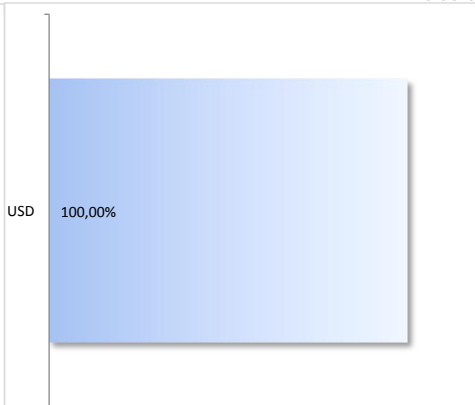
Izloženost fonda

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

Sektorska



Valutna



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

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 ulaze.