

# NFD Aureus US Algorithm

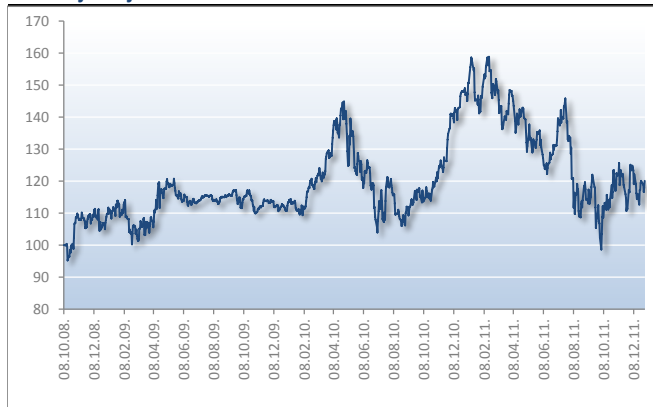
Mjesečni izvještaj - 30.12.2011.



## NFD AUREUS

Invest

### Kretanje vrijednosti NAV-a



|             | Fond    | Benchmark |
|-------------|---------|-----------|
| Od početka  | 20,07%  | 50,51%    |
| Ove godine  | -18,30% | -1,09%    |
| Ovaj mjesec | -2,77%  | 4,72%     |
| 1 godina    | -19,45% | -2,98%    |
| 6 mjeseci   | -8,52%  | 0,70%     |
| 3 mjeseca   | 17,30%  | 21,96%    |
| 1 mjesec    | -2,77%  | 4,72%     |
| 1 tjedan    | -0,02%  | 0,25%     |

#### Fond vs. Benchmark

|             |         |
|-------------|---------|
| Od početka  | -30,44% |
| Ove godine  | -17,21% |
| Ovaj mjesec | -7,50%  |
| 6 mjeseci   | -9,22%  |
| 3 mjeseca   | -4,66%  |

### 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      | 20.120.279,83 kn        |
| Vrijednost udjela | 120,0722 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

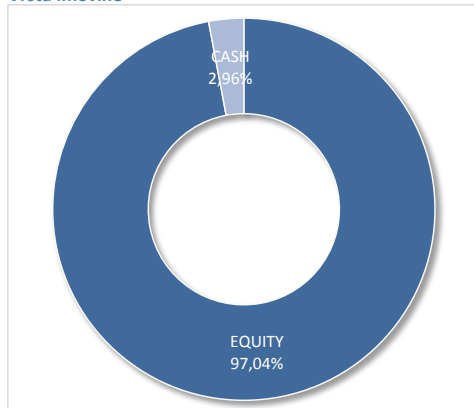
| Oznaka         | Ime                          | Zemlja        | Sektor                 | Udio  |
|----------------|------------------------------|---------------|------------------------|-------|
| AAPL US Equity | APPLE INC                    | UNITED STATES | Technology             | 4,69% |
| GMCR US Equity | GREEN MOUNTAIN COFFEE ROAS   | UNITED STATES | Consumer, Non-cyclical | 4,54% |
| MET US Equity  | METLIFE INC                  | UNITED STATES | Financial              | 4,51% |
| CLF US Equity  | CLIFFS NATURAL RESOURCES INC | UNITED STATES | Basic Materials        | 4,51% |
| HAL US Equity  | HALLIBURTON CO               | UNITED STATES | Energy                 | 4,50% |
| AMRN US Equity | AMARIN CORPORATION PLC -ADR  | IRELAND       | Consumer, Non-cyclical | 4,34% |
| JPM US Equity  | JPMORGAN CHASE & CO          | UNITED STATES | Financial              | 4,33% |
| NIHD US Equity | NII HOLDINGS INC             | UNITED STATES | Communications         | 4,32% |
| BTU US Equity  | PEABODY ENERGY CORP          | UNITED STATES | Energy                 | 4,31% |
| UAL US Equity  | UNITED CONTINENTAL HOLDINGS  | UNITED STATES | Consumer, Cyclical     | 4,21% |
| DVN US Equity  | DEVON ENERGY CORPORATION     | UNITED STATES | Energy                 | 4,13% |

### Sažetak investicijske politike fonda

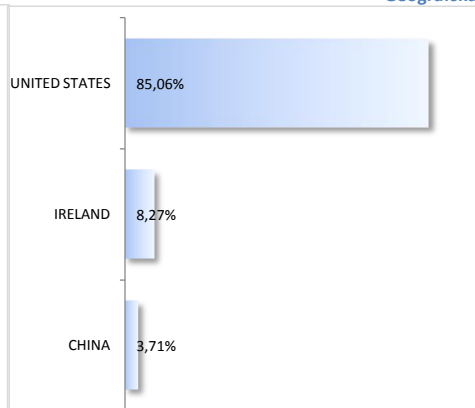
Traženje prinosa iznad benchmark indeksa korištenjem punog potencijala algoritamskih sustava. Algoritamski sustavi su temeljeni na postavkama bihevioralnih financija i matematičkim modelima koji su prevedeni u programski kod, inicijalno testirani na velikim uzorcima i različitim tržišnim uvjetima, a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



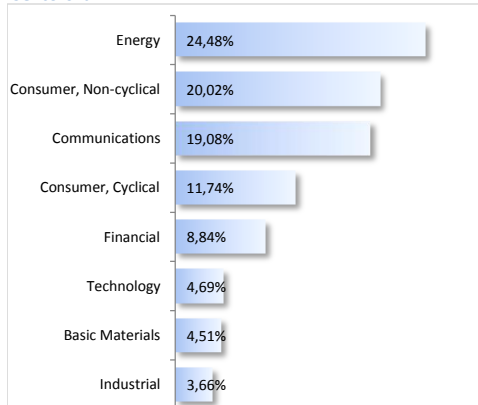
### Izloženost fonda

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

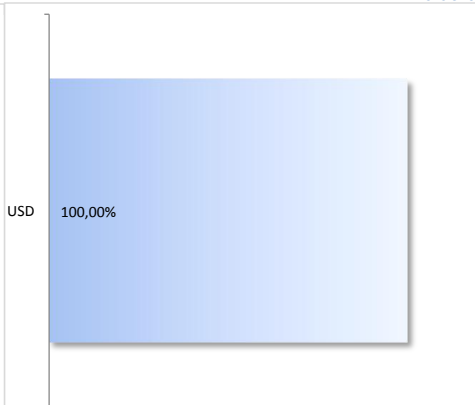
### Najmanja uplata, naknade i ostalo

|                     |                                       |
|---------------------|---------------------------------------|
| 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 ulaze.