

Clareo Abszolút Hozamú Származtatott Alap



marketprog
Asset Management

ÁLTALÁNOS INFORMÁCIÓK

Alapkezelő:	Marketprog Asset Management Zrt.
Letétkezelő:	Erste Bank Hungary Zrt.
Vezető forgalmazó:	Marketprog Asset Management Zrt.
Benchmark összetétele:	100% ZMAX Index
ISIN kód:	HU0000718242
Indulás:	2017.01.10
Devizanem:	HUF
A teljes alap nettó eszközértéke:	885 322 542 HUF
HUF sorozat nettó eszközértéke:	885 322 542 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	0,862341 HUF

BEFEKTETÉSI POLITIKA:

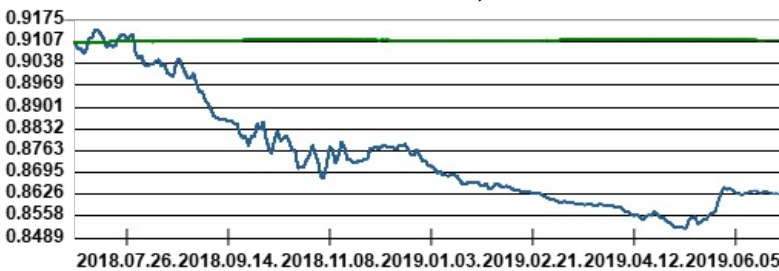
Clareo Abszolút Hozamú Származtatott Alap elsődleges célja az éven belüli állampapírokat reprezentáló kockázatmentes hozamnál magasabb megtérülés elérése hosszú távon többlet kockázatok vállalásával, döntően kötvénybefektetések és spekulatív származtatott ügyletek segítségével. Az Alapkezelő az Alap vagyonát abszolút hozamú szemléletben kezeli, megcélózva ezzel a kockázatmentes hozamot meghaladó megtérülést. Az Alapkezelő kiemelt figyelmet fordít a magas szintű és hatékony kockázatkezelésre, a volatilitás elfogadható szinten tartása érdekében. Az Alap összetételének kialakítása során az Alapkezelő dinamikusan alakítja ki a különböző eszközcsoportok súlyát a piaci helyzet és a követett stratégia függvényében. Az Alapkezelő befektetései során elsősorban a saját fejlesztésű technikai modelljeit használja a rövid- és középtávú pozícióinak kialakítása kapcsán. A potenciális befektetési terület globális és a lehető legszélesebb: hazai és nemzetközi részvények, kötvények; bankbetétek és Pénzpiaci eszközök, származtatott ügyletek. Az Alap emellett a globális devizapiac eszközeibe is befektet spekulatív vagy fedezési céllal.

FORGALMAZÓK

Erste Befektetési Zrt.

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2018.07.01 - 2019.06.30



— Clareo Abszolút Hozamú Származtatott Alap — Benchmark

A múltbeli hozamok nem jelentenek garanciát az alap jövőbeli teljesítményére nézve. Jelen hirdetés nem minősül ajánlattételnek vagy befektetési tanácsadásnak. A befektetés részletes feltételeit az Alap Tájékoztatója tartalmazza, mely a mindenkor érvényes kondíciós listákkal együtt megtalálható az forgalmazási helyeken. A befektetési alap forgalmazásával (vétel, tartás, eladás) kapcsolatos költségek az alap kezelési szabályzatában és a forgalmazási helyeken megismerhetők.

KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 2,72 %

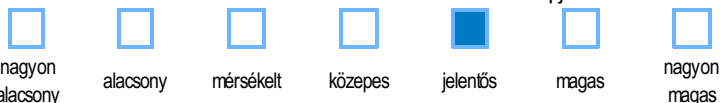
A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,06 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszaki szórása alapján:



PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

Az alap júniusban is főként az áru piacon kereskedett. Egy szója ügyletet zárt le a várt elmozdulást követően. A német 10 éves kötvény piacán továbbra is kitartunk azon álláspontunk mellett, hogy a hozam nem marad tartósan a negatív tartományban.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2019.06.30

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	84,78 %
Számlapénz	15,53 %
Kötelezettség	-0,02 %
Követelés	0,00 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	25,30 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	106,33 %

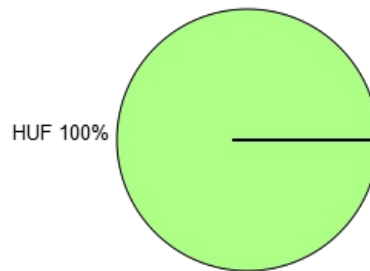
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

- 2022/C (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
- 2021B (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
- 2021C (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
- 2020C (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
- 2020A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

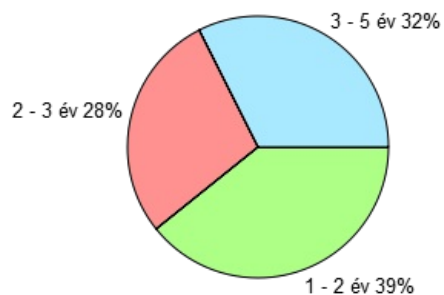
10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

- 2022/C (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
- 2021B (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
- 2021C (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

Devizánkénti megoszlás:



Lejárat szerinti megoszlás:



AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	-5,82 %	0,07 %
2018	-13,14 %	0,05 %