

MARKETPROG Multi Asset Vol10 Abszolút Hozamú Származtatott Részalap HUF sorozat



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: | HU0000714571 |
| Indulás: | 2015.06.04 |
| Devizanem: | HUF |
| A teljes alap nettó eszközértéke: | 202 882 540 HUF |
| HUF sorozat nettó eszközértéke: | 118 610 970 HUF |
| Egy jegyre jutó nettó eszközérték: | 0,835749 HUF |

BEFKETÉSI POLITIKA:

A MARKETPROG Technics Abszolút Hozamú Származtatott Részalap (továbbiakban: Részalap) 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 a Részalap vagyonát abszolút hozamú szemléletben kezeli, megelőzve ezzel a kockázatmentes hozamot meghaladó megtérülést. Az Alapkezelő kiemelt figyelmet fordít a magas szintű és hatékony kockázatkezelésre, a volatilitás elfogadható szinten tartása érdekében. A Részalap összetételének kialakítása során az Alapkezelő dinamikusan alakítja ki a különböző eszközcsoportok súlyát a piaci helyzet és a követett stratégia függvényében. Az Alapkezelő befektetési 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. A Részalap emellett a globális devizapiac eszközeibe is befektet spekulatív vagy fedezési céllal. A Részalap a jogszabályban meghatározott limitek és szorzószámok figyelembe vételével tőkeáttételes, hosszú (vételi) és fedezetlen rövid (eladási) pozíciókat is felvehet, de a teljes nettósított kockázati kitétsége nem haladhatja meg a 78/2014. (III. 14.) Korm. rendelet szerinti korrekció nélkül számított értéken figyelembe vett nettó eszközérték nyolcszorosát. A forintos sorozat referenciahozam a ZMAX index teljesítménye, az EUR sorozat az 1 hónapos EURIBOR kamatlábak átlaga.

FORGALMAZÓK

Concorde Értékpapír Zrt., Erste Befektetési Zrt., Marketprog Asset Management Zrt., SPB

AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

| Időtáv | Befektetési jegy | Benchmark |
|------------|------------------|-----------|
| indulástól | -2,83 % | 0,36 % |
| 2020 | -9,91 % | 0,44 % |
| 2019 | 3,20 % | 0,05 % |
| 2018 | 3,81 % | 0,05 % |
| 2017 | -7,50 % | 0,11 % |
| 2016 | 1,37 % | 0,81 % |

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2020.09.01 - 2021.08.31



MARKETPROG Multi Asset Vol10 Abszolút Hozamú Származtatott Részalap HUF sorozat

— 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 a forgalmazási helyeken. A befektetési alap forgalmazásával (vétel, tartás, eladás) kapcsolatos költségek az alap kezelési szabályzatában és a forgalmazási helyeken megismerhetők.

PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2021.08.31

| Eszköz típusa | Részarány |
|-----------------------------------|-----------|
| Kincstárjegyek | 49,15 % |
| Államkötvények | 15,61 % |
| Számlapénz | 35,85 % |
| Nyitott derivatív pozíciók értéke | -0,23 % |
| Összesen | 100,00 % |
| Származtatott ügyletek | 79,15 % |
| Nettó korrekciós tőkeáttétel | 61,54 % |

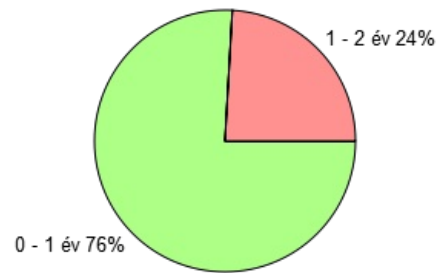
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

D211027 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D220309 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
REPHUN 2023/02/21 5,375% USD (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

D211027 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D220309 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
REPHUN 2023/02/21 5,375% USD (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

Lejárat szerinti megoszlás:



KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 7,77 %

A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,12 %

BEFKETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszaki szórása alapján:

