

# ActivityFund Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap



**marketpro**  
Asset Management

## ÁLTALÁNOS INFORMÁCIÓK

Alapkezelő:	Marketpro Asset Management Zrt.
Letétkezelő:	Unicredit Bank Zrt.
Vezető forgalmazó:	Marketpro Asset Management Zrt.
Benchmark összetétele:	100% ZMAX Index + 1%
ISIN kód:	HU0000727185
Indulás:	2021.06.29
Devizanem:	HUF
A teljes alap nettó eszközértéke:	226 737 171 HUF
HUF sorozat nettó eszközértéke:	226 737 171 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,056236 HUF

## BEFEKTETÉSI POLITIKA:

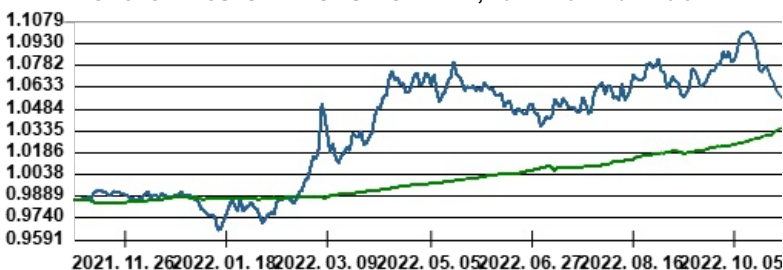
Az Alapkezelő az Alap vagyonát abszolút hozamú szemléletben kezeli, megelőzve ezzel a kockázatmentes hozamot meghaladó megtérülést. Az Alapkezelő kiemelt figyelmet fordít a magas szintű és hatékony kockázatkezelésre, a volatilitás elfogadható szinten tartása érdekében. Az Alap összetételének kialakítása 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 Pénzügyi eszközök, származtatott ügyletek. Az Alap emellett a globális devizapiac eszközeibe is befektet spekulatív vagy fedezési céllal. Az Alap a jogszabályban meghatározott limiték és szorzószámok figyelembe vételével tőkeáttételes, hosszú (vételi) és fedezetlen rövid (eladási) pozíciókat is felvehet, de a teljes nettósított kockázati kitettsége nem haladhatja meg a 78/2014. (III. 14.) Korm. rendelet szerinti korrekció nélkül számított értéken figyelembe vett nettó eszközérték nyolcszorosát. Az Alap referenciahozama: ZMAX+1%. Az Alapkezelőnek az alap kezelése során nem célja a fenntarthatósági tényezők előmozdítása.

## FORGALMAZÓK

Erste Befektetési Zrt.

## AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

### EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2021.11.01 - 2022.10.31



— ActivityFund Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési 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 a 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: 8,69 %

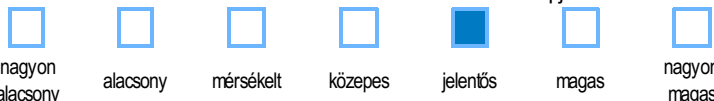
A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,83 %

## BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszakos szórása alapján:



## PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

Az Alap októberben is tartotta hosszú távú részvény long pozícióit, melyeket megfelelő méretű indexshortokkal fedezett.

Az árfolyam átmeneti visszaesését a devizakitettségre leértékelődése okozta.

Az EUR esetén teljes mértékben, míg USD esetén csak részben fedezte az Alap a kitettséget, hiszen továbbra is bízik a dollár erejében.

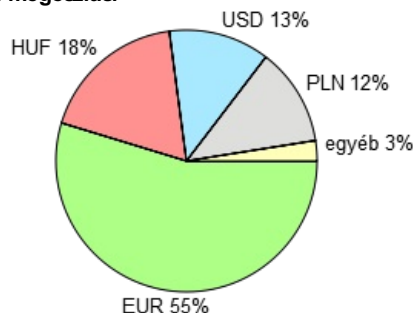
### A(z) 4 legnagyobb pozíció:

Magyar Telekom  
Esso Societe Anonyme Francaise SA  
National Bank of Greece SA  
Eurobank Ergasias SA

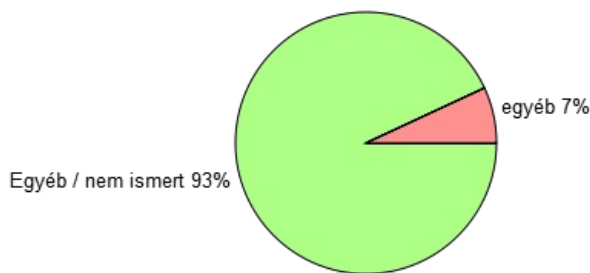
### 10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

Nincs ilyen eszköz a portfólióban

### Devizánkénti megoszlás:



### A részvények szektoronkénti megoszlása:



## AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	4,17 %	4,12 %