

Clareo Abszolút Hozamú Származtatott 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 |
| ISIN kód: | HU0000718242 |
| Indulás: | 2017.01.10 |
| Devizanem: | HUF |
| A teljes alap nettó eszközértéke: | 222 578 822 HUF |
| HUF sorozat nettó eszközértéke: | 222 578 822 HUF |
| Egy jegyre jutó nettó eszközérték: | 0,911240 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, 2017.07.01 - 2018.06.30



— 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 listával 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: 6,88 %

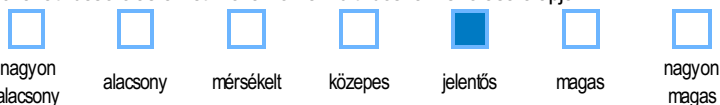
A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,04 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszaki szórása alapján:



PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

Az Alap a hónapban viszonylag kevés pozíciót vett fel, melyek alacsony kockázat mellett futottak. Az ezen termékeken megjelenő hirtelen, rövid időre fellépő jelentős volatilitás miatt többségük bekerülési áron zárásra került.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2018.06.30

| Eszköz típusa | Résarány |
|-----------------------------------|----------|
| Államkötvények | 83,29 % |
| Számlapénz | 20,35 % |
| Kötelezettség | -3,60 % |
| Nyitott derivatív pozíciók értéke | -0,05 % |
| Összesen | 100,00 % |
| Származtatott ügyletek | 17,80 % |
| Nettó korrekciós tőkeáttétel | 104,45 % |

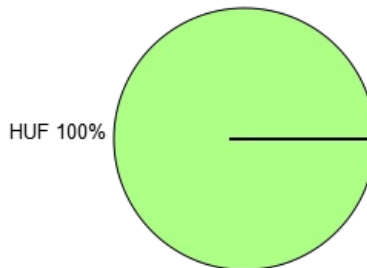
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

2018A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2020A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2020C (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

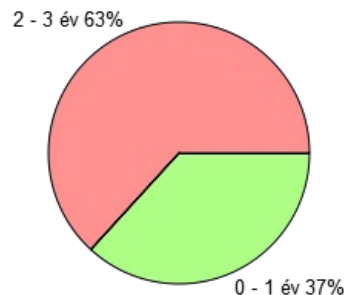
10%-nál magasabb résarányt képviselő eszközök

2018A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2020A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2020C (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

Devizánkénti megoszlás:



Lejárat szerinti megoszlás:



AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

| Időtáv | Befektetési jegy | Benchmark |
|------------|------------------|-----------|
| indulástól | -6,13 % | 0,07 % |