

# Double 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:	1 074 952 548 HUF
HUF sorozat nettó eszközértéke:	1 074 952 548 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	0,897545 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, 2020.11.01 - 2021.10.31



— Double 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 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: 5,04 %

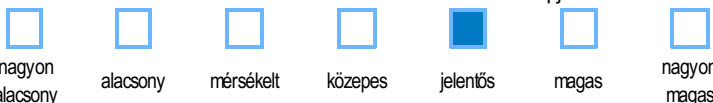
A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,13 %

## BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszaki szórása alapján:



## PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

### AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2021.10.31

Eszköz típusa	Részarány
Kincstárjegyek	32,13 %
Államkötvények	22,14 %
Nemzetközi részvények	12,91 %
Magyar részvények	3,98 %
Számlapénz	32,08 %
Kötelezettség	-5,22 %
Követelés	1,99 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	0,00 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	23,41 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	27,81 %

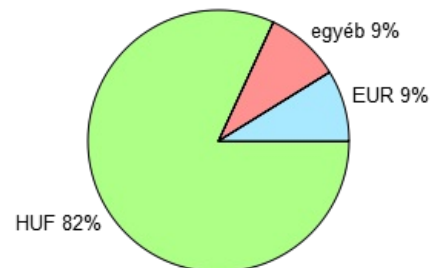
### A(z) 5 legnagyobb pozíció:

2022/C (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)  
D211215 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)  
D211103 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)  
Magyar Telekom  
Bayer AG részvény (BAYN GY)

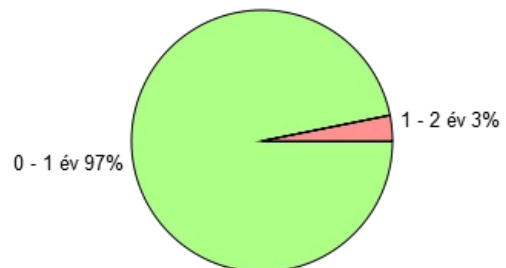
### 10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

2022/C (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)  
D211215 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)  
D211103 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

## Devizánkénti megoszlás:



## Lejárat szerinti megoszlás:



## AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	-2,22 %	0,21 %
2020	1,91 %	0,44 %
2019	-0,98 %	0,05 %
2018	-13,14 %	0,05 %