

MARKETPROG Multi Asset Vol10 Abszolút Hozamú Származtatott Részalap HUF sorozat



marketprog
Asset Management

ÁLTALÁNOS INFORMÁCIÓK

Alapkezelő:	Marketprog Asset Management Zrt.
Letétkezelő:	Unicredit Bank 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:	202 476 672 HUF
HUF sorozat nettó eszközértéke:	115 962 186 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	0,817085 HUF

BEFEKTETÉSI POLITIKA:

A MARKETPROG Multi Asset Vol. 10 Abszolút Hozamú Származtatott Részalap (továbbiakban: Részalap) elsődleges célja, hogy a globálisan legszélesebb körben elérhető eszközosztályokba történő befektetés útján az éven belüli kockázatmentes kamatnál magasabb hozamot érjen el többlet kockázatok vállalásán keresztül. A Részalap úgy alakítja ki portfólióját, hogy befektetéseiinek aggregált volatilitása 10%-ot célozzon meg. A befektetések összetétele rendszeres időközönként felülvizsgálatra kerül. A cél volatilitástól való eltérés esetén a Részalap meglévő eszközeit súlyozza át, vagy új eszközöket vesz fel portfóliójába a cél elérése érdekében. Az Alapkezelő, a portfólió összetétele és az eszközök közötti súlyok kialakítása során nagyrészt pénzügyi modellek igénybe vételére, kisebb részben saját piaci megítéléseire támaszkodik. A potenciális befektetési terület globális és a lehető legszélesebb: hazai és nemzetközi részvények, kötvények, ETF-ek; bankbetétek és egyéb pénzügyi instrumentumok; származtatott ügyletek. A Részalap emellett a globális devizapiaci 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 referenciahozam a ZUMAX index teljesítménye. A Részalapot magas kockázatú hajlandósággal rendelkező befektetőknek ajánljuk, akik 1 éves időtartamban a betéteknél és a pénzügyi befektetéseknél magasabb hozamot szeretnének realizálni.

FORGALMAZÓK

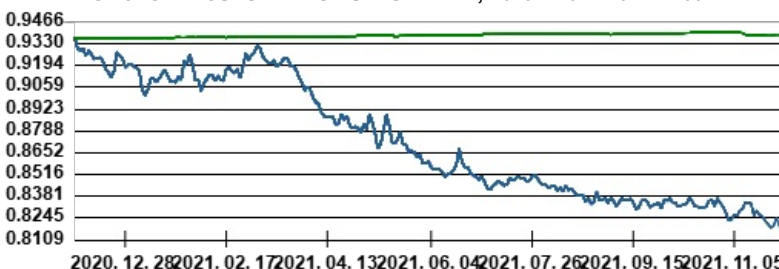
Concorde Értékpapír Zrt., Erste Befektetési Zrt., Marketprog Asset Management Zrt., SPB

AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	-3,06 %	0,33 %
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, 2020.12.01 - 2021.11.30



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 2021.11.30

Eszköz típusa	Részarány
Kincstárjegyek	53,96 %
Államkötvények	17,06 %
Számlapénz	30,72 %
Követelés	0,01 %
Kötelezettség	0,00 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	-1,26 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	99,76 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	69,53 %

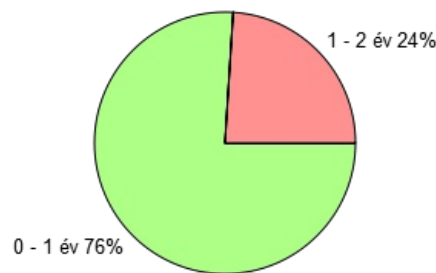
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

D220223 (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

D220223 (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: 4,83 %
A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,27 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszaki szórása alapján:

