

Prestige Abszolút Hozamú Származtatott Részalap

HUF sorozat



marketpro
Asset Management

ÁLTALÁNOS INFORMÁCIÓK

Alapkezelő:	Marketpro Asset Management Zrt.
Letétkezelő:	Unicredit Bank Zrt.
Vezető forgalmazó:	Marketpro Asset Management Zrt.
Benchmark összetétele:	100% Constans ref. index (HUF) + 3%
ISIN kód:	HU0000714571
Indulás:	2015.06.04
Devizanem:	HUF
A teljes alap nettó eszközértéke:	1 242 861 130 HUF
HUF sorozat nettó eszközértéke:	1 181 686 245 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	0,860592 HUF

BEFETETÉSI POLITIKA:

A Prestige Abszolút Hozamú Származtatott Részalap (továbbiakban: Részalap) elsődleges célja, hogy a globálisan legszélesebb körben elérhető eszközosztályokba történő befektetés útján az előre meghatározott kockázati profil figyelembevételével az adott sorozatra meghatározott Referenciamutatónál magasabb hozamot érjen el többet 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 igénybevételére, 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 devizapiac eszközeibe is befektet spekulatív vagy fedezési céllal. A Részalap a jogszabályban meghatározott limitek és szorzószámok figyelembevételével 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. A tőkeáttétellel való kereskedés az adott ügyletbe fektetett összegnél is nagyobb mértékű veszteséggel járhat. A Prestige Abszolút Hozamú Származtatott Részalap "EUR" sorozatának Referenciamutató értéke 50 bázispont. A Részalapot kockázattalálló ügyfeleinknek ajánljuk, hosszú távú pénzügyi célok megvalósításához, azok számára, akik akár hosszabb távon is tolerálni képesek a mérsékelt árfolyamveszteségeket. A Részalap adott esetben nem megfelelő azon befektetők számára, akik 3 éven belül ki akarják venni a Részalapról a pénzüket. Az Alapkezelőnek az alap kezelése során nem célja a fenntarthatósági tényezők előmozdítása.

FORGALMAZÓK

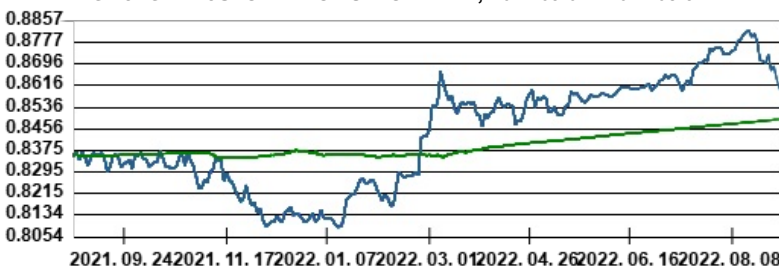
Concorde Értékpapír Zrt., Erste Befektetési Zrt., Marketpro Asset Management Zrt., SPB

AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	-2,05 %	0,53 %
2021	-11,45 %	0,39 %
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, 2021.09.01 - 2022.08.31



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.

PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

Az alap árfolyama augusztusban alacsonyabban zárt júliushoz képest, 1,71%-kal csökkent. A hónap folyamán az alapba jelentős tőkebeáramlás történt, amelyeket feltörekvő piaci kötvénycsúszásra fordítottunk maximum 3 éves futamidővel. Jelenlegi növekvő kamatkörnyezet kockázata miatt nem terveztük szignifikáns mennyiségű hosszabb lejáratú kötvény vásárlását. A devizakockázat fedezését továbbra is fenntartottuk. Augusztus második felében a piacon tapasztalható negatív tendenciával összefüggésben az alap értéke is kis mértékben visszaesett a long irányú spekulatív pozíciókon keresztül. Erre reflektálva az ilyen jellegű ügyletek tőkére vetített mértékét ideiglenesen lecsökkentettük a kockázat alacsony tartása céljából. Egyéb stratégiáink marginális mértékűek, így nem befolyásolták jelentősen az alap ehavi teljesítményét. A jelenlegi gazdasági környezetben a piac irányultságát nehéz előre meghatározni, emiatt a diszkrécionális döntéshozatal helyett továbbra is határozottan kitartunk a statisztikai modellekre építő stratégiák mellett. Augusztus hónapban is törekedtünk az alacsony volatilitásra szűk stop szintek és szigorú kockázatkezelés alkalmazásával.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2022.08.31

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	40,25 %
Kincstárjegyek	30,93 %
Vállalati és hitelintézeti kötvények	6,58 %
Számlapénz	11,13 %
Betét	4,83 %
Követelés	3,27 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	3,16 %
Kötelezettség	-0,01 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	81,24 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	19,09 %

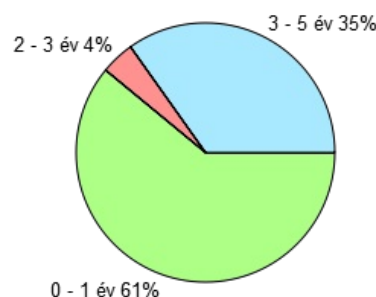
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

US T-Bill 0 10/13/22 (Amerikai Egyesült Államok)
ROMANI 2025/10/29 2,75% EUR (Román Állam)
D230823 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
REPHUN 2023/02/21 5,375% USD (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
REPHUN 2025/10/22 1,25 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

US T-Bill 0 10/13/22 (Amerikai Egyesült Államok)
ROMANI 2025/10/29 2,75% EUR (Román Állam)
D230823 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
REPHUN 2023/02/21 5,375% USD (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
REPHUN 2025/10/22 1,25 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

Lejárat szerinti megoszlás:



KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 5,16 %

A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,43 %

BEFETETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:

3 hó 6 hó 1 év 2 év 3 év 4 év 5 év

Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszakos szórása alapján:

nagyon alacsony alacsony mérsékelt közepes jelentős magas nagyon magas