

Prestige Abszolút Hozamú Származtatott Részalap EUR 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 referencia index (EUR) + 0,5%
ISIN kód:	HU0000714563
Indulás:	2020.06.16
Devizanem:	EUR
A teljes alap nettó eszközértéke:	1 261 440 968 HUF
EUR sorozat nettó eszközértéke:	147 959 EUR
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	0,008054 EUR

BEFEKTETÉSI 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 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 igénybevételére, kisebb részben saját piaci megítéléseire támaszkodik. A potenciális befektetési terület globális és a lehető legszélesebb: hazai és nemzetközi részvények, kötvények, ETF-ek; kockázati 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 kitétsége 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 árfolyamvesztéseket. A Részalap adott esetben nem megfelelő azon befektetők számára, akik 3 éven belül ki akarják venni a Részalaptól a pénzüket. Az Alapkezelőnek az alap kezelése során nem célja a fenntarthatósági tényezők előmozdítása.

FORGALMAZÓK

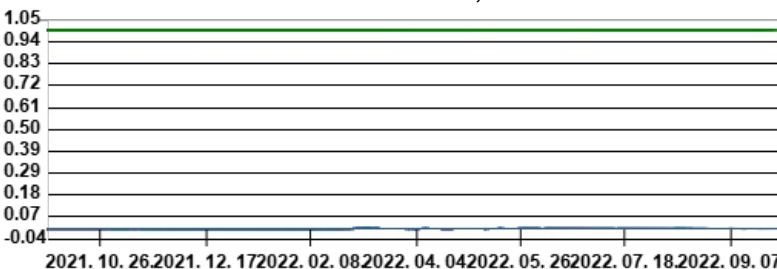
Marketpro Asset Management Zrt.

AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	-9,02 %	-0,23 %
2021	-11,94 %	-0,54 %

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2021.10.01 - 2022.09.30



— Prestige Abszolút Hozamú Származtatott Részalap EUR 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 az 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 szeptemberben alacsonyabban zárt augusztushoz képest, 1,47%-kal csökkent. Ennek oka a kötvényhozamok jelentős emelkedése, illetve a fejlett részvénypiacok drasztikus esése (az S&P500 -9,36%-kal zárta a hónapot). A defenzív stratégiának köszönhetően utóbbiból csak kisebb mértékben részesültünk az S&P500-ra kötött kis súlyú származtatott ügyleteken keresztül. A nagyobb mértékű visszaesést put opciók vételével kerültk el. Pozícióink jelentős részét devizakötvények és magyar állampapírok alkották. A piacokon évről évre megfigyelhető szezonális, miszerint az őszi hónapok, különösen a szeptember alulteljesíti az átlagos részvénypiaci hozamokat. Ennek megfelelően döntöttünk az óvatos kockázatkezelés mellett, de szándékunkban áll a részénkitettségek növelni, ha azt a piaci körülmények indokolják. A forint piacán az átlagosnál nagyobb volatilitás volt jellemző az euróhoz és dollárhoz képest, ezért ebben az eszközben nem kívántunk pozíciót felvenni, emiatt devizakitétségekünket folyamatosan fedeztük.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2022.09.30

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	40,30 %
Kincstárjegyek	34,53 %
Vállalati és hitelintézeti kötvények	6,72 %
Számlapénz	14,41 %
Betét	7,14 %
Kötelezettség	-0,61 %
Követelés	0,35 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	-3,05 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	83,86 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	14,21 %

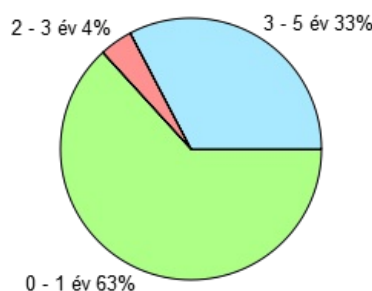
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

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: 8,87 %
A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,07 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszaki szórása alapján:

