

MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap HUF sorozat



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:	HU0000714555
Indulás:	2015.06.04
Devizanem:	HUF
A teljes alap nettó eszközértéke:	9 875 753 905 HUF
HUF sorozat nettó eszközértéke:	4 960 514 960 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,373420 HUF

BEFEKTETÉSI POLITIKA:

A MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap (továbbiakban: Részalap) elsődleges célja a kockázatmentes hozamnál magasabb megtérülés elérése hosszú távon többlet kockázatok vállalásával, döntően kötvénybefektetések és spekulatív származtatott ügyletek segítségével. Az Alapkezelő a Részalap 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. A Részalap összetételének kialakítása során az Alapkezelő dinamikusan alakítja ki a különböző eszközcsoportok súlyát a piaci helyzet és a követett stratégia függvényében. Az Alapkezelő a fundamentális elemzések mellett kiemelt figyelmet fordít a piaci hangulat ingadozására, és a technikai elemzés eszközeit is használja a piacra lépés időzítésekor. A potenciális befektetési terület elsősorban, de nem kizárólag a közép-kelet európai kötvénypiac és annak derivatív piaci. A Részalap emellett a globális devizapiac eszközeibe is befektet spekulatív vagy fedezési céllal. A Részalap a jogszabályban meghatározott limitiek és szorzószámok figyelembe vételével 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. Az "A" és "I" (forintos) sorozatok referenciahozama a ZMAX index teljesítménye, az EUR sorozat az 1 hónapos EURIBOR kamatlábak átlaga.

FORGALMAZÓK

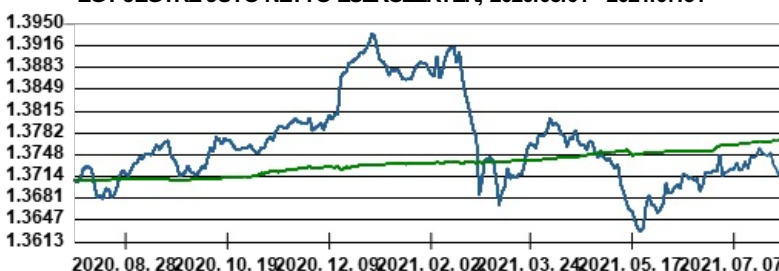
Concorde Értékpapír Zrt., Erste Befektetési Zrt., Marketprog Asset Management Zrt., SPB, Takarékbank

AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	5,29 %	0,37 %
2020	3,27 %	0,44 %
2019	5,10 %	0,05 %
2018	-0,82 %	0,05 %
2017	6,62 %	0,11 %
2016	18,09 %	0,81 %

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2020.08.01 - 2021.07.31



MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény 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 2021.07.31

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	56,89 %
Kollektív értékpapírok	15,98 %
Vállalati és hitelintézeti kötvények	7,30 %
Követelés	17,03 %
Állampapír repo ügyletek	2,16 %
Számlapénz	1,00 %
Kötelezettség	-0,06 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	-0,06 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	140,65 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	68,08 %

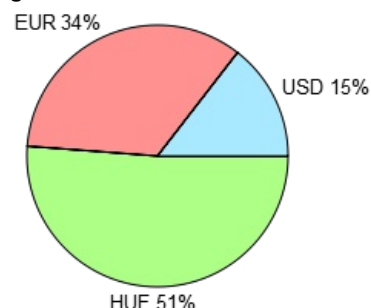
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

2023C (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
Romani 2,75 02/26/26 (Román Állam)
Accorde USD rövid kötvény alap
IINVBK 2 03/22/22 (International Investment Bank)
2038A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

2023C (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
Romani 2,75 02/26/26 (Román Állam)
Accorde USD rövid kötvény alap
IINVBK 2 03/22/22 (International Investment Bank)
2038A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2027B (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

Devizánkénti megoszlás:



KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 1,64 %

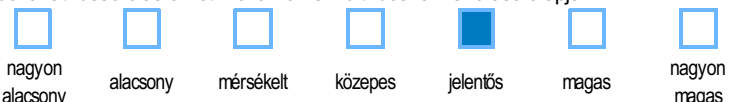
A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,10 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszaki szórása alapján:



nagyon alacsony alacsony mérsékelt közepes jelentős magas nagyon magas