

# MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap A sorozat



marketprog  
Asset Management

## ÁLTALÁNOS INFORMÁCIÓK

|                                    |                                     |
|------------------------------------|-------------------------------------|
| Alapkezelő:                        | Marketprog Asset Management Zrt.    |
| Letétkezelő:                       | Unicredit Bank Zrt.                 |
| Vezető forgalmazó:                 | Marketprog Asset Management Zrt.    |
| Benchmark összetétele:             | 100% Constans ref. index (HUF) + 2% |
| ISIN kód:                          | HU0000714555                        |
| Indulás:                           | 2015.06.04                          |
| Devizanem:                         | HUF                                 |
| A teljes alap nettó eszközértéke:  | 10 074 183 645 HUF                  |
| HUF sorozat nettó eszközértéke:    | 5 302 294 727 HUF                   |
| Egy jegyre jutó nettó eszközérték: | 1,480968 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, megelőzve 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 kitétsége nem haladhatja meg a 78/2014. (III. 14.) Kom. 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. Az Alapkezelőnek az alap kezelése során nem célja a fenntarthatósági tényezők előmozdítása.

## FORGALMAZÓK

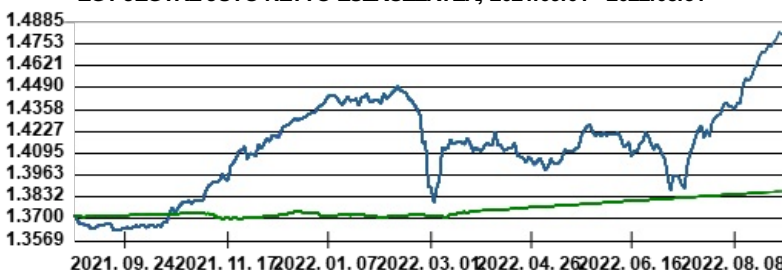
Concorde Értékpapír Zrt., Erste Befektetési Zrt., Marketprog Asset Management Zrt., Raiffeisen Bank Zrt., SPB, Takarékbank

## AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

| Időtáv     | Befektetési jegy | Benchmark |
|------------|------------------|-----------|
| indulástól | 5,57 %           | 0,46 %    |
| 2021       | 2,99 %           | 0,39 %    |
| 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, 2021.09.01 - 2022.08.31



## MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap A sorozat

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 2022.08.31

| Eszköz típusa                        | Részarány |
|--------------------------------------|-----------|
| Kollektív értékpapírok               | 21,78 %   |
| Államkötvények                       | 7,46 %    |
| Vállalati és hitelintézeti kötvények | 4,06 %    |
| Állampapír repo ügyletek             | 89,94 %   |
| Kötelezettség                        | -36,11 %  |
| Követelés                            | 12,30 %   |
| Betét                                | 3,78 %    |
| Számlapénz                           | 2,10 %    |
| Nyitott derivatív pozíciók értéke    | -4,53 %   |
| Összesen                             | 100,00 %  |
| Származtatott ügyletek               | 461,98 %  |
| Nettó korrekciós tőkeáttétel         | 141,23 %  |

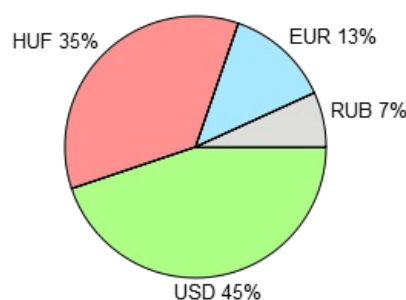
### A(z) 5 legnagyobb pozíció:

|                                            |
|--------------------------------------------|
| 2029B (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)   |
| 2027B (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)   |
| Accorde USD rövid kötvény alap             |
| Reverse Max Származtatott Befektetési Alap |
| 2034A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)   |

### 10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

|                                          |
|------------------------------------------|
| 2029B (Államadósság Kezelő Központ Zrt.) |
| 2027B (Államadósság Kezelő Központ Zrt.) |
| Accorde USD rövid kötvény alap           |

## Devizánkénti megoszlás:



## KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 5,17 %  
A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,39 %

## BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszaki szórása alapján:

