

MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap EUR 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 referencia index (EUR)
ISIN kód:	HU0000714548
Indulás:	2016.05.23
Devizanem:	EUR
A teljes alap nettó eszközértéke:	8 861 374 766 HUF
EUR sorozat nettó eszközértéke:	532 555 EUR
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	0,011651 EUR

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 kitettsége 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 sorozatá az 1 hónapos EURIBOR kamatlábak átlaga.

FORGALMAZÓK

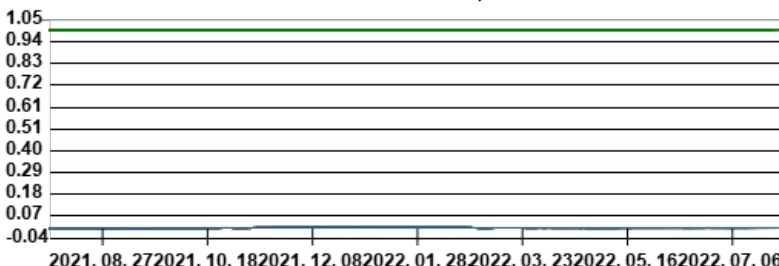
Concorde Értékpapír Zrt., Erste Befektetési Zrt., SPB

AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	2,50 %	-0,39 %
2021	2,63 %	-0,54 %
2020	2,58 %	-0,46 %
2019	4,45 %	-0,38 %
2018	-1,25 %	-0,37 %
2017	6,11 %	-0,37 %

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2021.08.01 - 2022.07.31



MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény 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 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 2022.07.31

Eszköz típusa	Részarány
Kollektív értékpapírok	23,67 %
Vállalati és hitelintézeti kötvények	2,82 %
Államkötvények	-8,54 %
Állampapír repo ügyletek	75,27 %
Betét	9,47 %
Számlapénz	1,73 %
Kötelezettség	-0,98 %
Követelés	0,05 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	-4,69 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	505,33 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	151,20 %

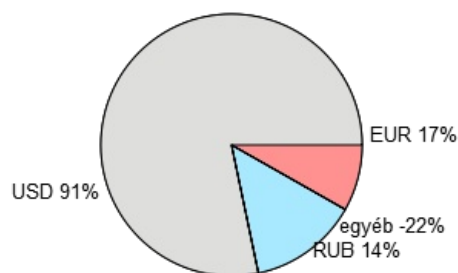
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

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

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

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

Devizánkénti megoszlás:



KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 5,87 %

A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,04 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszaki szórása alapján:

