

MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap C sorozat



marketprog
Asset Management

ÁLTALÁNOS INFORMÁCIÓK

| | |
|------------------------------------|----------------------------------|
| Alapkezelő: | Marketprog Asset Management Zrt. |
| Letétkezelő: | Unicredit Bank Zrt. |
| Vezető forgalmazó: | Marketprog Asset Management Zrt. |
| Benchmark összetétele: | 100% ZMAX Index |
| ISIN kód: | HU0000719356 |
| Indulás: | 2017.09.12 |
| Devizanem: | HUF |
| A teljes alap nettó eszközértéke: | 9 483 737 681 HUF |
| C sorozat nettó eszközértéke: | 3 637 850 406 HUF |
| Egy jegyre jutó nettó eszközérték: | 1,169037 HUF |

BEFKETÉSI 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, megcélozva 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.) 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 sorozaté az 1 hónapos EURIBOR kamatlábak átlaga.

FORGALMAZÓK

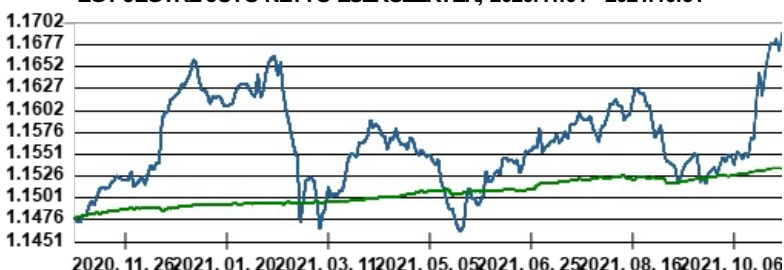
Concorde Értékpapír Zrt., Marketprog Asset Management Zrt.

AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

| Időtáv | Befektetési jegy | Benchmark |
|------------|------------------|-----------|
| indulástól | 3,85 % | 0,22 % |
| 2020 | 4,72 % | 0,44 % |
| 2019 | 6,75 % | 0,05 % |
| 2018 | 0,57 % | 0,05 % |

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2020.11.01 - 2021.10.31



MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap C 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 2021.10.31

| Eszköz típusa | Részarány |
|--------------------------------------|-----------|
| Államkötvények | 24,90 % |
| Kollektív értékpapírok | 17,29 % |
| Vállalati és hitelintézeti kötvények | 7,66 % |
| Állampapír repo ügyletek | 44,09 % |
| Kötelezettség | -26,47 % |
| Számlapénz | 24,98 % |
| Követelés | 6,89 % |
| Nyitott derivatív pozíciók értéke | 0,57 % |
| Összesen | 100,00 % |
| Származtatott ügyletek | 831,06 % |
| Nettó korrekciós tőkeáttétel | 148,94 % |

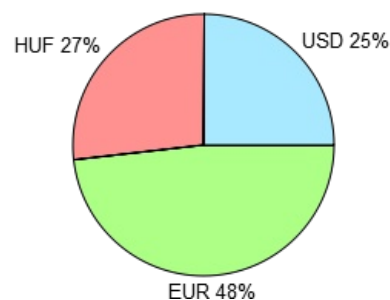
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

Romani 2,75 02/26/26 (Román Állam)
Accorde USD rövid kötvény alap
IINVBK 2 03/22/22 (International Investment Bank)
2027B (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
GAZPRU 02/17/27 1,5 (GAZPROM PLC)

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

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

Devizánkénti megoszlás:



KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 1,86 %

A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,13 %

BEFKETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:

| | | | | | | |
|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| 3 hó | 6 hó | 1 év | 2 év | 3 év | 4 év | 5 év |

Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszaki szórása alapján:

| | | | | | | |
|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| nagyon alacsony | alacsony | mérsékelt | közepes | jelentős | magas | nagyon magas |