

# 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:  | 9 805 744 644 HUF                |
| C sorozat nettó eszközértéke:      | 3 450 710 536 HUF                |
| Egy jegyre jutó nettó eszközérték: | 1,217647 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 piaci 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 sorozaté az 1 hónapos EURIBOR kamatlábak átlaga.

## FORGALMAZÓK

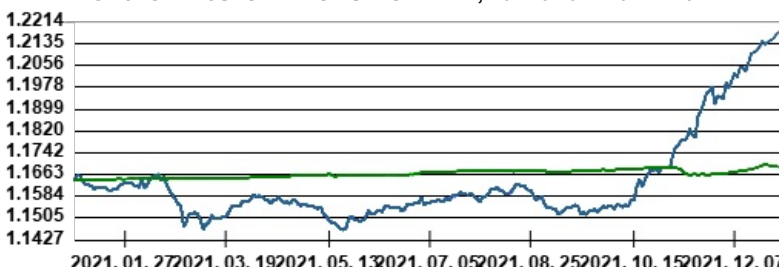
Concorde Értékpapír Zrt., Marketprog Asset Management Zrt.

## AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

| Időtáv     | Befektetési jegy | Benchmark |
|------------|------------------|-----------|
| indulástól | 4,68 %           | 0,22 %    |
| 2021       | 4,57 %           | 0,39 %    |
| 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, 2021.01.01 - 2021.12.31



## 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 2021.12.31

| Eszköz típusa                        | Részarány |
|--------------------------------------|-----------|
| Államkötvények                       | 35,06 %   |
| Kollektív értékpapírok               | 17,63 %   |
| Vállalati és hitelintézeti kötvények | 7,47 %    |
| Számlapénz                           | 42,75 %   |
| Kötelezettség                        | -3,17 %   |
| Nyitott derivatív pozíciók értéke    | 0,80 %    |
| Követelés                            | 0,00 %    |
| Összesen                             | 100,00 %  |
| Származtatott ügyletek               | 334,10 %  |
| Nettó korrekciós tőkeáttétel         | 91,54 %   |

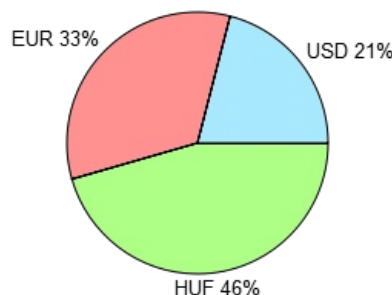
### A(z) 5 legnagyobb pozíció:

Accorde USD rövid kötvény alap  
Romani 2,75 02/26/26 (Román Állam)  
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

Accorde USD rövid kötvény alap  
Romani 2,75 02/26/26 (Román Állam)  
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: 2,21 %  
A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,31 %

### BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszaki szórása alapján:

