

MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap "I" 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:	HU0000714688
Indulás:	2015.06.04
Devizanem:	HUF
A teljes alap nettó eszközértéke:	8 416 923 013 HUF
Intézményi sorozat nettó eszközértéke:	702 036 441 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,436998 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 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 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 sorozatá az 1 hónapos EURIBOR kamatlábak átlaga.

FORGALMAZÓK

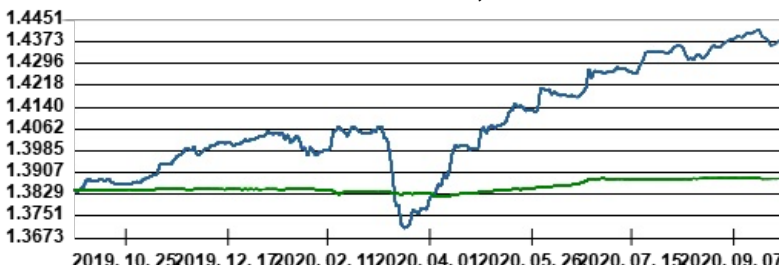
Concorde Értékpapír Zrt., Marketprog Asset Management Zrt., Takarékbank

AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	7,05 %	0,34 %
2019	6,00 %	0,05 %
2018	0,18 %	0,05 %
2017	7,55 %	0,11 %
2016	19,11 %	0,81 %

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2019.10.01 - 2020.09.30



MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap "I" 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 2020.09.30

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	62,00 %
Kollektív értékpapírok	10,70 %
Vállalati és hitelintézeti kötvények	9,17 %
Számlapénz	18,62 %
Követelés	6,95 %
Kötelezettség	-6,62 %
Állampapír repo ügyletek	0,55 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	-1,00 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	170,33 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	49,51 %

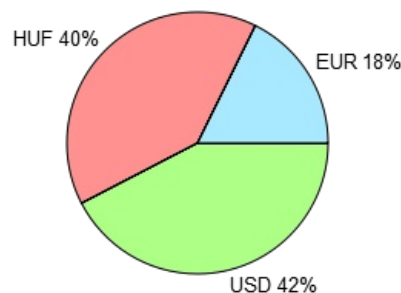
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

2023C (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
REPHUN 2023/02/21 5,375% USD (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
IINVBK 2 03/22/22 (International Investment Bank)
REPHUN 2024/03 5,375% USD (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
ROMANI 6.75% 2022/02 USD (Román Állam)

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

2023C (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
REPHUN 2023/02/21 5,375% USD (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
IINVBK 2 03/22/22 (International Investment Bank)

Devizánkénti megoszlás:



KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 2,80 %
A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,24 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszaki szórása alapján:

