

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:	9 831 444 103 HUF
C sorozat nettó eszközértéke:	3 634 871 688 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,194502 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, 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 piaca 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	4,31 %	0,18 %
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, 2020.12.01 - 2021.11.30



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 2021.11.30

Eszköz típusa	Részarány
Vállalati és hitelintézeti kötvények	32,00 %
Kollektív értékpapírok	17,21 %
Államkötvények	15,74 %
Kötelezettség	-70,35 %
Követelés	60,78 %
Betét	25,44 %
Állampapír repo ügyletek	15,15 %
Számlapénz	2,27 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	2,03 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	1 024,46 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	178,14 %

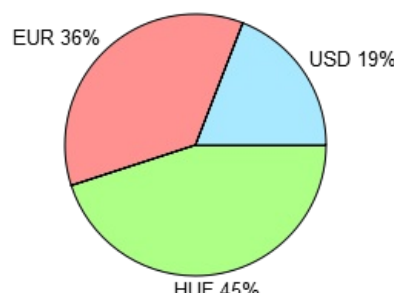
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

MFB 3.9 10/22/2028 (Magyar Fejlesztési Bank Zrt.)
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.)

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

MFB 3.9 10/22/2028 (Magyar Fejlesztési Bank Zrt.)
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: 2,14 %

A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,27 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszaki szórása alapján:

