

MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap D 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 ref. index (HUF) + 2%
ISIN kód:	HU0000730288
Indulás:	2022.08.16
Devizanem:	HUF
A teljes alap nettó eszközértéke:	10 074 183 645 HUF
D sorozat nettó eszközértéke:	916 377 300 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,018197 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 piacai. 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 sorozaté az 1 hónapos EURIBOR kamatlábak átlaga. Az Alapkezelőnek az alap kezelése során nem célja a fenntarthatósági tényezők előmozdítása.

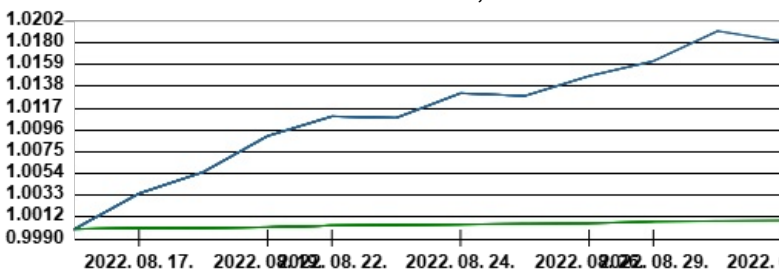
FORGALMAZÓK

AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	1,82 %	0,08 %

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2022.08.16 - 2022.08.31



MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap D 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 2022.08.31

Eszköz típusa	Részarány
Kollektív értékpapírok	21,78 %
Államkötvények	7,46 %
Vállalati és hitelintézeti kötvények	4,06 %
Állampapír repo ügyletek	89,94 %
Kötelezettség	-36,11 %
Követelés	12,30 %
Betét	3,78 %
Számlapénz	2,10 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	-4,53 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	461,98 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	141,23 %

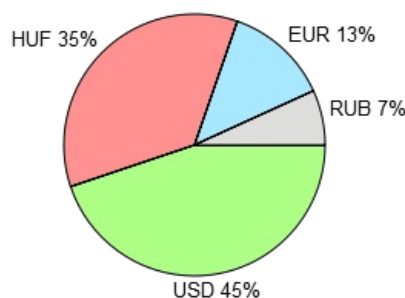
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

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

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

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

Devizánkénti megoszlás:



KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: nincs adat

A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: nincs adat

BEFEKTETÉSI 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