

MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap EUR 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% EURIBOR 1M |
| ISIN kód: | HU0000714548 |
| Indulás: | 2016.05.23 |
| Devizanem: | EUR |
| A teljes alap nettó eszközértéke: | 8 307 816 763 HUF |
| EUR sorozat nettó eszközértéke: | 797 957 EUR |
| Egy jegyre jutó nettó eszközérték: | 0,011753 EUR |

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 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.) 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

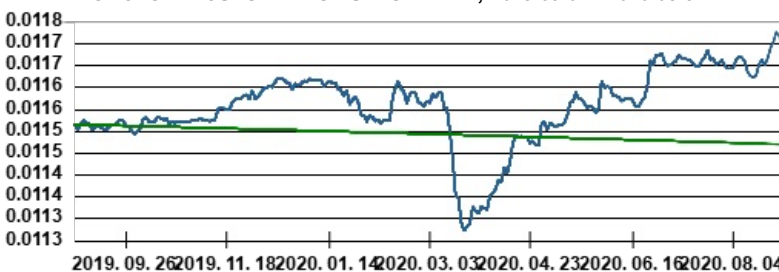
Concorde Értékpapír Zrt., Erste Befektetési Zrt., Marketprog Asset Management Zrt., SPB

AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

| Időtáv | Befektetési jegy | Benchmark |
|------------|------------------|-----------|
| indulástól | 3,85 % | -0,39 % |
| 2019 | 4,45 % | -0,38 % |
| 2018 | -1,25 % | -0,37 % |
| 2017 | 6,11 % | -0,37 % |

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2019.09.01 - 2020.08.31



MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap EUR 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 2020.08.31

| Eszköz típusa | Részarány |
|---------------------------------------|-----------|
| Államkötvények | 81,06 % |
| Vállalati és hitelintézetek kötvények | 9,00 % |
| Kollektív értékpapírok | 7,50 % |
| Számlapénz | 4,19 % |
| Nyitott derivatív pozíciók értéke | 1,07 % |
| Kötelezettség | -0,27 % |
| Állampapír repo ügyletek | -2,28 % |
| Összesen | 100,00 % |
| Származtatott ügyletek | 74,23 % |
| Nettó korrekciós tőkeáttétel | 34,33 % |

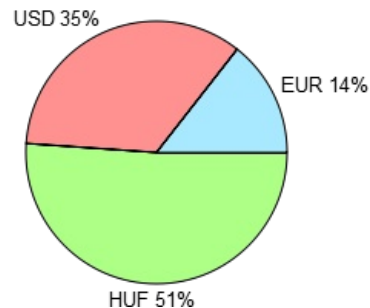
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

| |
|---|
| 2025C (Államadósság Kezelő Központ Zrt.) |
| IINVBK 2 03/22/22 (International Investment Bank) |
| REPHUN 2023/02/21 5,375% USD (Államadósság Kezelő Központ Zrt.) |
| REPHUN 2024/03 5,375% USD (Államadósság Kezelő Központ Zrt.) |
| ROMANI 6.75% 2022/02 USD (Román Állam) |

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

| |
|---|
| 2025C (Államadósság Kezelő Központ Zrt.) |
| IINVBK 2 03/22/22 (International Investment Bank) |
| REPHUN 2023/02/21 5,375% USD (Államadósság Kezelő Központ Zrt.) |

Devizánkénti megoszlás:



KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 3,12 %
A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,01 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszaki szórása alapján:

