

MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap "I" 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: | HU0000714688 |
| Indulás: | 2015.06.04 |
| Devizanem: | HUF |
| A teljes alap nettó eszközértéke: | 9 528 896 972 HUF |
| Intézményi sorozat nettó eszközértéke: | 834 602 371 HUF |
| Egy jegyre jutó nettó eszközérték: | 1,473982 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 piacra 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

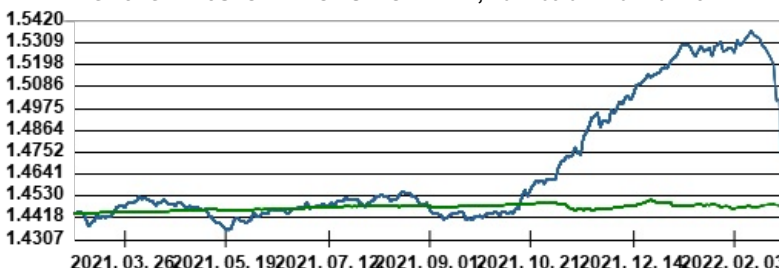
Concorde Értékpapír Zrt., Marketprog Asset Management Zrt., Takarékbank

AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

| Időtáv | Befektetési jegy | Benchmark |
|------------|------------------|-----------|
| indulástól | 5,93 % | 0,33 % |
| 2021 | 3,93 % | 0,39 % |
| 2020 | 4,16 % | 0,44 % |
| 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, 2021.03.01 - 2022.02.28



MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap "I" sorozat

— Benchmark

A múltbéli 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 2022.02.28

| Eszköz típusa | Részarány |
|---------------------------------------|------------|
| Államkötvények | 49,15 % |
| Kollektív értékpapírok | 18,34 % |
| Vállalati és hitelintézetek kötvények | 3,12 % |
| Betét | 26,25 % |
| Kötelezettség | -4,39 % |
| Állampapír repo ügyletek | 4,14 % |
| Számlapénz | 2,66 % |
| Nyitott derivatív pozíciók értéke | 0,81 % |
| Követelés | 0,00 % |
| Összesen | 100,00 % |
| Származtatott ügyletek | 1 206,68 % |
| Nettó korrekciós tőkeáttétel | 199,03 % |

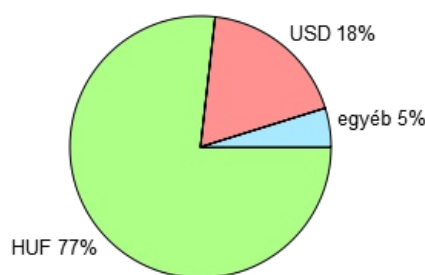
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

2027B (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
Accorde USD rövid kötvény alap
IINVBK 2 03/22/22 (International Investment Bank)
2032G (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
Reverse Max Származtatott Befektetési Alap

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

2027B (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
Accorde USD rövid kötvény alap
IINVBK 2 03/22/22 (International Investment Bank)

Devizánkénti megoszlás:



KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 2,25 %
A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,35 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszaki szórása alapján:

