

MARKETPROG Bond Kötvény Származtatott Részalap EUR 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 referencia index (EUR) + 2,5%
ISIN kód:	HU0000714548
Indulás:	2016.05.23
Devizanem:	EUR
A teljes alap nettó eszközértéke:	13 353 870 032 HUF
EUR sorozat nettó eszközértéke:	3 152 997 EUR
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	0,015179 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, 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 piacai. A Részalap emellett a globális devizapiac eszközeibe is befektet spekulatív vagy fedezési céllal. A Részalap a jogszabályban meghatározott limitek 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. Az Alapkezelőnek az alap kezelése során nem célja a fenntarthatósági tényezők előmozdítása.

FORGALMAZÓK

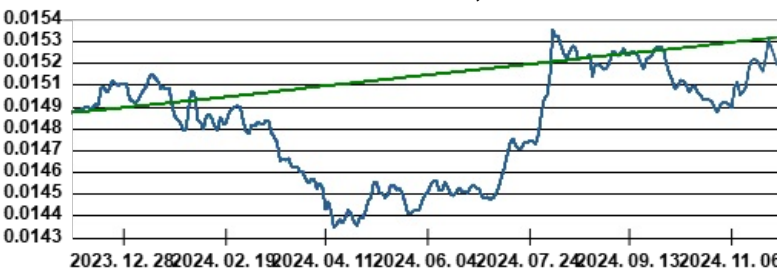
Concorde Értékpapír Zrt., Erste Befektetési Zrt., Raiffeisen Bank Zrt., SPB

AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	5,02 %	0,22 %
2023	7,82 %	2,03 %
2022	13,80 %	-0,05 %
2021	2,63 %	-0,54 %
2020	2,58 %	-0,46 %
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, 2023.12.01 - 2024.11.30



MARKETPROG Bond 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 2024.11.30

Eszköz típusa	Részarány
Vállalati és hitelintézeti kötvények	41,79 %
Államkötvények	34,44 %
Kollektív értékpapírok	10,60 %
Állampapír repo ügyletek	9,65 %
Betét	2,43 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	1,12 %
Számlapénz	0,04 %
Kötelezettség	0,00 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	397,40 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	67,36 %

A(z) 5 legnagyobb pozíció:

2027B (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
MAEXIM 7 02/12/25 (Magyar Export-Import Bank Zrt.)
2029B (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
MBH 2026B EUR 9% (MBH Bank)
2032B (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

2027B (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
MAEXIM 7 02/12/25 (Magyar Export-Import Bank Zrt.)
2029B (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
MBH 2026B EUR 9% (MBH Bank)
2032B (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

Devizánkénti megoszlás:



KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 5,47 %

A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,07 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszakos szórása alapján:

