

MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap
A sorozatmarketprog
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) + 5,5%
ISIN kód:	HU0000714555
Indulás:	2015.06.04
Devizanem:	HUF
A teljes alap nettó eszközértéke:	13 791 011 385 HUF
HUF sorozat nettó eszközértéke:	8 490 445 518 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	2,011469 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 vagyontát 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 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.) 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

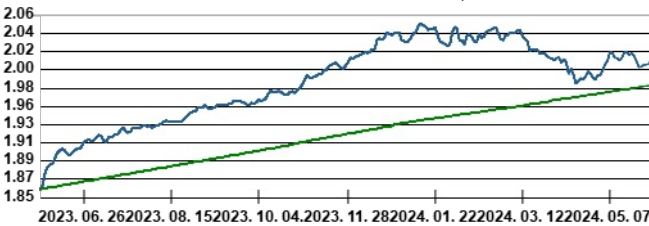
Concorde Értékpapír Zrt., Erste Befektetési Zrt., Marketprog Asset Management Zrt., Raiffeisen Bank Zrt., SPB, Takarékbank, Uniqa Forgalmazási

AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	8,08 %	1,51 %
2023	16,04 %	7,27 %
2022	22,87 %	1,73 %
2021	2,99 %	0,39 %
2020	3,27 %	0,44 %
2019	5,10 %	0,05 %
2018	-0,82 %	0,05 %
2017	6,62 %	0,11 %
2016	18,09 %	0,81 %

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2023.06.01 - 2024.05.31



— MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap A 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 listával 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 2024.05.31

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	51,36 %
Vállalati és hitelintézeti kötvények	42,94 %
Kollektív értékpapírok	9,30 %
Kötelezettség	-16,19 %
Követelés	16,13 %
Betét	1,60 %
Számlapénz	0,01 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	-4,94 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	452,99 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	65,11 %

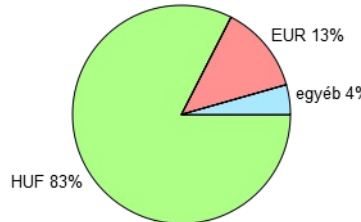
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

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)

Devizánkénti megoszlás:



KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 3,63 %

A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,20 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszakai szórása alapján:

