

MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap
A sorozat

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: | 13 858 256 068 HUF |
| HUF sorozat nettó eszközértéke: | 8 491 884 804 HUF |
| Egy jegyre jutó nettó eszközérték: | 2,081725 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 devizapiaci 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 | 8,34 % | 1,58 % |
| 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



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 2024.07.31

| Eszköz típusa | Részarány |
|--------------------------------------|-----------|
| Államkötvények | 49,41 % |
| Vállalati és hitelintézeti kötvények | 46,58 % |
| Kollektív értékpapírok | 9,42 % |
| Követelés | 10,53 % |
| Kötelezettség | -10,52 % |
| Számlapénz | 0,01 % |
| Nyitott derivatív pozíciók értéke | -1,28 % |
| Állampapír repo ügyletek | -3,77 % |
| Összesen | 100,00 % |
| Származtatott ügyletek | 167,60 % |
| Nettó korrekciós tőkeáttétel | 38,99 % |

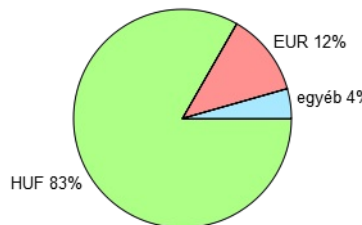
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

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

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.) |

Devizánkénti megoszlás:



KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 3,48 %

A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,18 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszakai szórása alapján:

