

MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap
USD sorozat

ÁLTALÁNOS INFORMÁCIÓK

Alapkezelő:	Marketprog Asset Management Zrt.
Letétkezelő:	Unicredit Bank Zrt.
Vezető forgalmazó:	Marketprog Asset Management Zrt.
Benchmark összetétele:	100% constans ref index (USD) + 3%
ISIN kód:	HU0000719364
Indulás:	2024.02.19
Devizanem:	USD
A teljes alap nettó eszközértéke:	13 858 256 068 HUF
USD sorozat nettó eszközértéke:	30 USD
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	0,010017 USD

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 vagyontól 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.

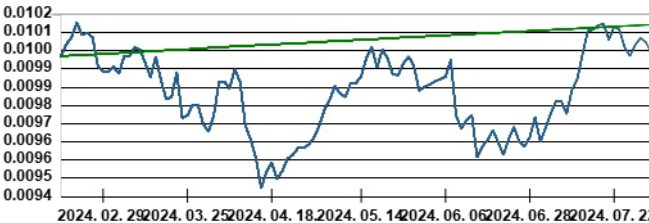
FORGALMAZÓK

AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	0,17 %	1,34 %
1 hónap	3,80 %	0,27 %
3 hónap	3,84 %	0,76 %

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2024.02.19 - 2024.07.31



— MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap USD 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 listával együtt megtalálható a forgalmazási helyeken. A befektetés 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: 6,66 %

A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,06 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



3 hó



6 hó



1 év



2 év



3 év



4 év



5 év

Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszakai szórása alapján:

nagyon
alacsony

alacsony



mérsékelt



közepes



jelentős



magas

nagyon
magas