

MARKETPROG Bond Derivatív 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% EURIBOR 1M
ISIN kód:	HU0000714548
Indulás:	2016.05.23
Devizanem:	EUR
Ateljes alap nettó eszközértéke:	1 198 859 198 HUF
EUR sorozat nettó eszközértéke:	405 072 EUR
Egyjegyre jutó nettó eszközérték:	0,010243 EUR

BEFEKTETÉSI POLITIKA:

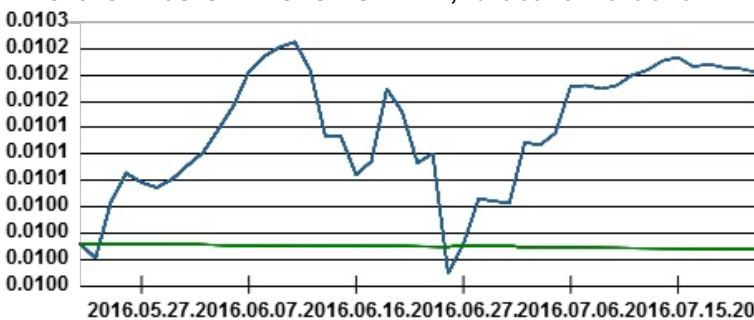
A MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap (továbbiakban: Részalap) elsődleges célja a kockázatmentes hozamnál magasabb megtérülés elérése hosszú távon többlet kockázatok vállalásával, döntően kötvénybefektetések és spekulatív származtatott ügyletek segítségével. Az Alapkezelő a Részalap vagyonát abszolút hozamú szemléletben kezeli, 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.) Korm. rendelet szerinti korrekció nélkül számított értéken figyelembe vett nettó eszközérték nyolcszorosát. A referenciahozam a ZMAX index teljesítménye.

FORGALMAZÓK

Concorde Értékpapír Zrt.

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2016.05.23 - 2016.07.31



--- MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap EUR s
---- 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:

A július hónap alapvetően pozitív hangulatban telt, mind a világ részvénypiacai, mind a kötvénypiacok erőteljes emelkedésen mentek keresztül. Elsősorban a júniusban tapasztalt nagy árfolyamesés és magas volatilitás visszarendeződésének lehettünk tanúi. A devizapiacokon a dollár csöndes volt az euróval, szemben, míg a jen ismét gyengülni tudott. A forint jelentősen erősödött, ismét 312 alatt zárta a hónapot. A hazai kötvénypiac is sokat erősödött, a magyar hozamgörbe a lengyel hozamgörbe alá esett.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2016.07.31

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	50,86 %
Kincstárjegyek	20,18 %
Számlapénz	25,95 %
Követelés	1,12 %
Kötelezettség	-0,12 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	0,01 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	0,00 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	100,00 %

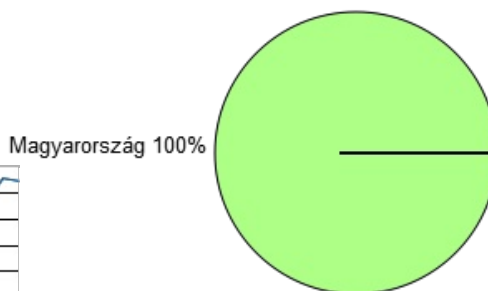
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

2018A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2019C (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D160803 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D170524 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

2018A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2019C (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D160803 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

Arészvények országokénti megoszlása:



AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	2,43 %	-0,07 %
10 hónap	1,94 %	-0,04 %

KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 2,67 %
Abenchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,02 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

Ajavasolt minimális befektetési idő:

3 hó 6 hó 1 év 2 év 3 év 4 év 5 év

Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszak szórása alapján:

nagyon alacsony alacsony mérsékelt közepes jelentős magas nagyon magas