

MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap EUR sorozat



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:	1 278 267 115 HUF
EUR sorozat nettó eszközértéke:	509 992 EUR
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	0,010280 EUR

BEFEKTETÉSI POLITIKA:

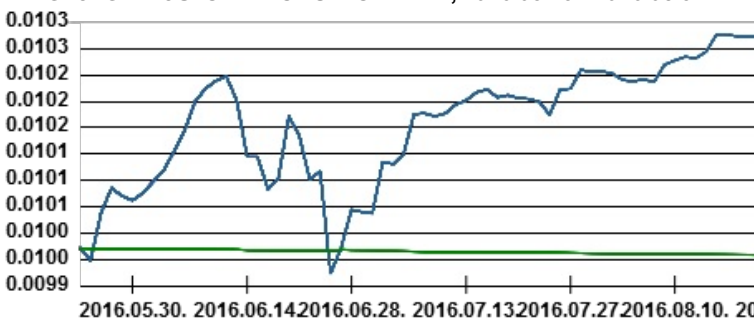
A MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap (továbbiakban: Részalap) elsődleges célja a kockázatmentes hozamnál magasabb megtérülés elérése hosszú távon többlet kockázatok vállalásával, döntően kötvénybefektetések és spekulatív származtatott ügyletek segítségével. Az Alapkezelő a Részalap 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., SPB

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2016.05.23 - 2016.08.31



--- MARKETPROG Bond Derivatív 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:

Augusztus hónapban a folytatódott az elmúlt hónapokban tapasztalt erősödés. A kötvénypiacok és részvénypiacok további emelkedést könyvelhettek el, de az emelkedés dinamikája csökkent. A befektetők az 1-2 napig tartó korrekcióra még inkább vásárlással reagáltak, de újabb csúcsokat már nem értek el az árfolyamok.

A hazai kötvénypiac a júliusi nagy hozamcsökkenést követően augusztusban kis mértékben ugryn, de még erősödni tudott.

A forint tovább szárnyalt és megközelítette a 308-es szintet az euróval szemben, mely szint az eddigiekben lényegében a sáv alját képviselte.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2016.08.31

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	48,59 %
Kincstárjegyek	29,45 %
Számlapénz	23,30 %
Kötelezettség	-0,08 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	0,00 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	0,00 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	100,00 %

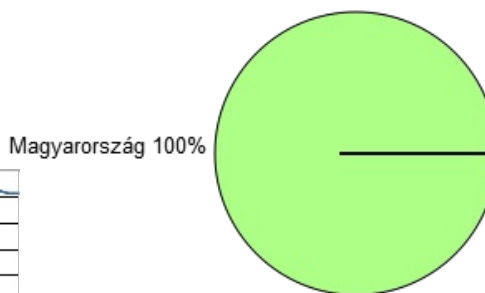
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

D170719 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
 2018A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
 2019C (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
 2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
 D161130 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

D170719 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
 2018A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
 2019C (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
 2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

Arészvények országokénti megoszlása:



AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	2,80 %	-0,10 %
1 hónap	0,36 %	-0,03 %
3 hónap	2,02 %	-0,09 %

KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 2,68 %
 A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,02 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

Á javasolt minimális befektetési idő:

3 hó 6 hó 1 év 2 év 3 év 4 év 5 év

Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszakos szórása alapján:

nagyon alacsony alacsony mérsékelt közepes jelentős magas nagyon magas