

MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap "I" sorozat



marketprog
Asset Management

ÁLTALÁNOS INFORMÁCIÓK

Alapkezelő:	Marketprog Asset Management Zrt.
Letétkezelő:	Unicredit Bank Zrt.
Vezető forgalmazó:	Marketprog Asset Management Zrt.
Benchmark összetétele:	100% ZMAX Index
ISIN kód:	HU0000714688
Indulás:	2015.06.04
Devizanem:	HUF
A teljes alap nettó eszközértéke:	111 067 645 HUF
Intézményi sorozat nettó eszközértéke:	100 084 541 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	0,999174 HUF

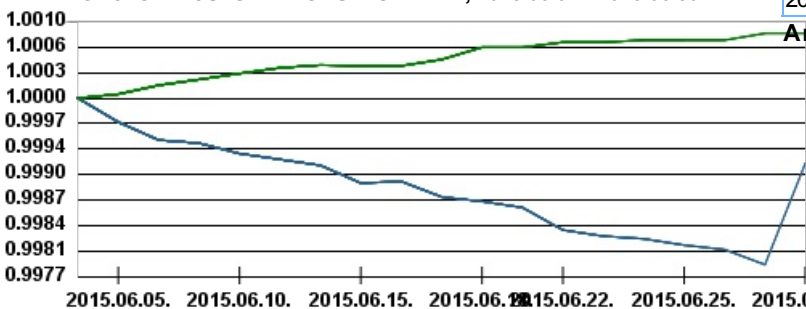
BEFEKTETÉSI POLITIKA:

A MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap (továbbiakban: Részalap) elsődleges célja a kockázatmentes hozammal 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

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2015.06.04 - 2015.06.30



MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap "I" 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:

Június hónapban folytatódott a májusban már elkezdődött kockázatcsökkentési folyamat a befektetők részéről.

A hosszabb futamidejű fejlett piaci kötvényekhozamok emelkedtek, ezzel párhuzamosan a fejlődő piaci kötvényinstrumentumok szintén vesztek az értékükből.

A részvénypiacok szintén a gyengeség jeleit mutatták, júliusban már kifejezetten megerősítésre talált a főbb indexek esési hajlandósága.

Természetesen a júliusi esés egyik legfőbb mozgatórugója a görög pénzügyi válsággal áll összefüggésben, melynek kimenetelét igen nehéz megjósolni, ezért befektetői oldalon egy óvatos, konzervatív befektetési stílust eredményez. A piacok volatilitása jelentősen emelkedett, mely kockázatkezelési szempontból is sok befektetőt a biztonságosabb rövid futamidejű állampapírok irányába terelte.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2015.06.30

Eszköz típusa	Részarány
Kincstárjegyek	112,18 %
Állampapírok	62,43 %
Kötelezettség	-74,87 %
Számlapénz	0,46 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	0,00 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	100,20 %

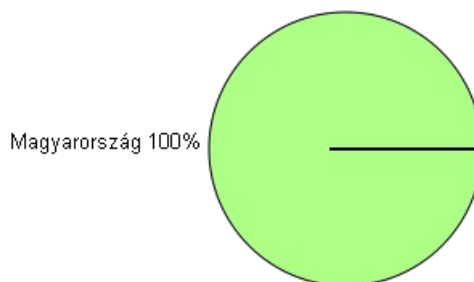
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

D151111 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D150729 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D150909 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2018D (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2021A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

D151111 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D150729 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D150909 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2018D (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2021A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

A részvények országokénti megoszlása:



AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	-0,08 %	0,08 %

KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,01 %

A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,02 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT

A javasolt minimális befektetési idő:

<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
3 hó	6 hó	1 év	2 év	3 év	4 év	5 év

Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszakos szórása alapján:

<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
nagyon alacsony	alacsony	mérsékelt	közepes	jelentős	magas	nagyon magas