

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
A teljes alap nettó eszközértéke:	1 593 235 721 HUF
EUR sorozat nettó eszközértéke:	1 018 928 EUR
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	0,010407 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, megelőzve ezzel a kockázatmentes hozam 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 piaci. A Részalap emellett a globális devizapiac eszközeibe is befektet spekulatív vagy fedezési céllal. A Részalap a jogszabályban meghatározott limitiek 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 sorozatá az 1 hónapos EURIBOR kamatlábak átlaga.

FORGALMAZÓK

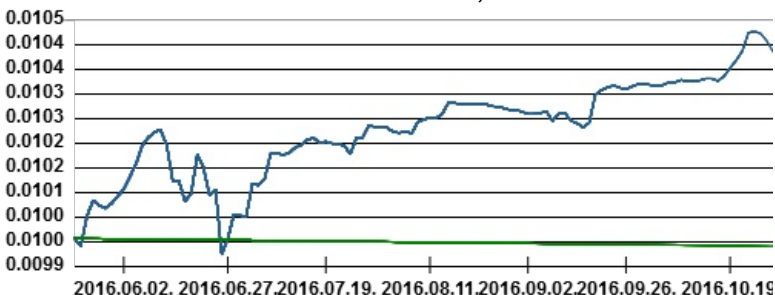
Concorde Értékpapír Zrt., SPB

AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	4,07 %	-0,16 %
1 hónap	0,71 %	-0,03 %
3 hónap	1,60 %	-0,09 %

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2016.05.23 - 2016.10.31



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:

A piaci volatilitás magas volt október hónapban. Igaz volt ez a részvénytőzsiacra, kötvénypiacra és a devizákra is. A nemzetközi kötvénypiacokon a hozamemelkedési trend folytatódott, a magyar kötvényekben még a gyengülés jelei nem voltak tapasztalhatóak. A részvénytőzsiacokon az augusztus óta zajló kitérőzés folytatódott, melynek oka a november eleji amerikai elnökválasztással kapcsolatos bizonytalanság. A devizák tekintetében a dollár inkább erősödött az euróval szemben, míg a forint gyengült az euróval szemben.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2016.10.31

Eszköz típusa	Részarány
Kincstárjegyek	39,98 %
Államkötvények	38,69 %
Számlapénz	20,41 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	0,56 %
Követelés	0,35 %
Kötelezettség	0,00 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	141,43 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	135,36 %

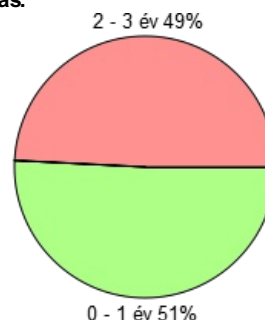
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

D170719 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2018A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2019C (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D161228 (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.)
D161228 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

Lejárat szerinti megoszlás:



KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 2,88 %
A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,02 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszaki szórása alapján:

