

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: | 5 852 765 695 HUF |
| EUR sorozat nettó eszközértéke: | 1 940 677 EUR |
| Egy jegyre jutó nettó eszközérték: | 0,011303 EUR |

BEFKETÉSI 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 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 piaci. 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 kitettsége 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.

FORGALMAZÓK

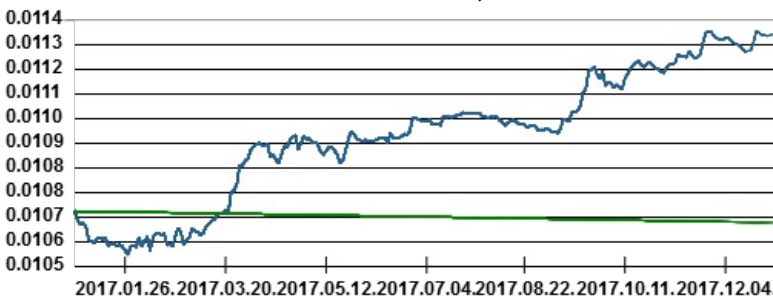
Concorde Értékpapír Zrt., Erste Befektetési Zrt., Marketprog Asset Management Zrt., SPB

AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

| Időtáv | Befektetési jegy | Benchmark |
|------------|------------------|-----------|
| indulástól | 7,92 % | -0,37 % |
| 2017 | 6,11 % | -0,37 % |

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2017.01.01 - 2017.12.31



MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap EUR 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 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:

December hónapban az alap tartotta a kötvény long pozícióját. A hozamgörbe kis mértékben alacsonyabb szintre süllyedt. Az alap teljesítménye decemberben hónapban hozzávetőlegesen 0,2%-kal emelkedett.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2017.12.31

| Eszköz típusa | Részarány |
|--------------------------------------|-----------|
| Államkötvények | 32,99 % |
| Vállalati és hitelintézeti kötvények | 27,07 % |
| Jelzáloglevelek | 3,59 % |
| Kollektív értékpapírok | 1,67 % |
| Számlapénz | 33,28 % |
| Követelés | 0,39 % |
| Kötelezettség | -0,36 % |
| Nyitott derivatív pozíciók értéke | 0,10 % |
| Összesen | 100,00 % |
| Származtatott ügyletek | 82,96 % |
| Nettó korrekciós tőkeáttétel | 120,74 % |

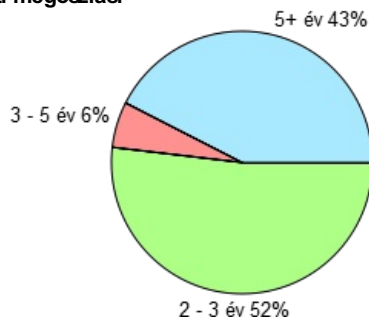
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

2026D (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2020A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2020P (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2020O (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2020B (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

2026D (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2020A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

Lejárat szerinti megoszlás:



KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 2,96 %

A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,01 %

BEFKETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszaki szórása alapján:



nagyon alacsony alacsony mérsékelt közepes jelentős magas nagyon magas