

MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap HUF 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:	HU0000714555
Indulás:	2015.06.04
Devizanem:	HUF
A teljes alap nettó eszközértéke:	107 504 486 HUF
HUF sorozat nettó eszközértéke:	7 007 056 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,001008 HUF

BEFETTESÉSI POLITIKA:

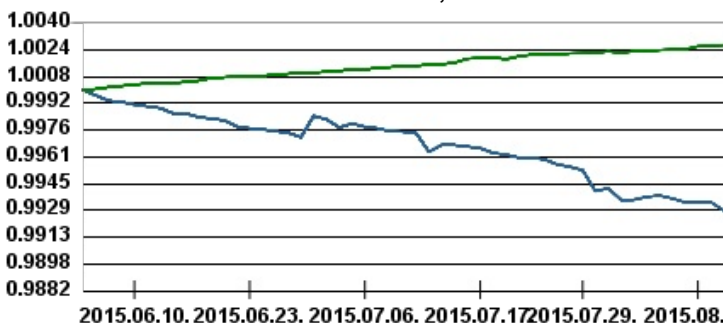
A MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap (továbbiakban: Részalap) elsődleges célja a kockázatmentes hozamnál magasabb megtérülés elérése hosszú távon többlet kockázatok vállalásával, döntően kötvénybefektetések és spekulatív származtatott ügyletek segítségével. Az Alapkezelő a Részalap 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 kitettsége 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 ELMŰLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2015.06.04 - 2015.08.31



--- MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap HUF 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 listával 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:

Az idei évben eddig az augusztusi hónap volt a leginkább kockázatosnak modható időszak a rendkívül nagy árfolyammozgások következtében. A kínai gazdasági lassulás híre elbizonytalanította a befektetőket, így a kockázatosabb eszközökből, komoly összegeket vontak ki. A részvénypiacon a német index hozzávetőlegesen 15%-ot, míg az amerikai index 11%-ot veszített értékéből kevesebb, mint 2 hét alatt. A pánikadások érintették a vállalati kötvények és a fejlődő piacok instrumenrumait is. A több, mint 6 éve tartó részvénypiaci emelkedésben ez a momentum volt lényegében az első olyan figyelmeztető jel, mely előrevetíthet egy esetleges tartósabb törést a részvények származásában.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2015.08.31

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	64,56 %
Kincstárjegyek	14,86 %
Számlapénz	21,25 %
Kötelezettség	0,00 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	0,00 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	100,00 %

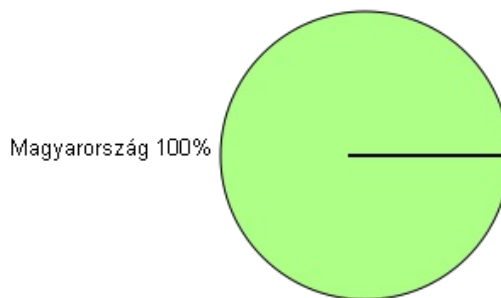
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

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

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

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

A részvények országokénti megoszlása:



Magyarország 100%

AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	0,10 %	0,32 %
1 hónap	0,68 %	0,09 %

KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMŰLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,25 %
A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,03 %

BEFETTESÉSI HORIZONT:

A javasolt 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