

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:	718 276 136 HUF
HUF sorozat nettó eszközértéke:	16 267 290 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,102312 HUF

BEFEKTETÉSI POLITIKA

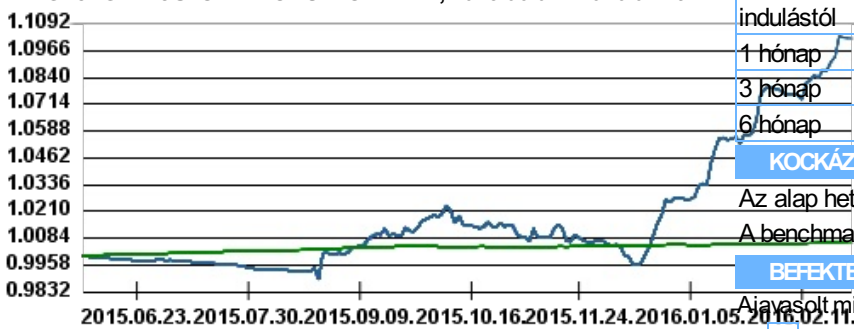
A MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap (továbbiakban: Részalap) elsődleges célja a kockázatmentes hozamnál magasabb megtérülés elérése hosszú távon többlet kockázatok vállalásával, döntően kötvénybefektetések és spekulatív származtatott ügyletek segítségével. Az Alapkezelő a Részalap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

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

Egy JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2015.06.04 - 2016.02.29



— 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 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:

Február hónapban a részvénypiacok nagy volatilitást mutattak, ellenben a hónap eleji értékekhez képest csak kis százalékos elmozdulást produkáltak hónap végére. A devizapiacokon is a dollár párokban, hasonlóan a részvényiacokhoz, egy jelentős árfolyamingadozás alakult ki. Aforint újra letörte a 310-es árszintet az euróval szemben.

A hazai kötvénypiac tovább kényeztette a hosszabb futamidővel rendelkező befektetőket, hiszen újabb 15 bázispontos hozamcsökkenés következett be. A hazai részvénypiac a felébredés jeleit mutatta, a hónap második felétől jelentős emelkedés következett be a papírokban.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2016.02.29

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	86,85 %
Számlapénz	19,50 %
Állampapír repo ügyletek	-5,12 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	0,00 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	100,00 %

A(z) 5 legnagyobb pozíció:

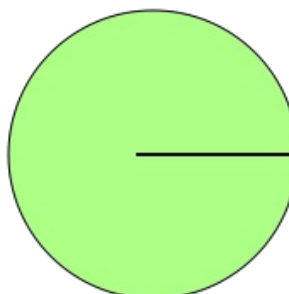
2018A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2019C (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

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

Arészvények országokénti megoszlása:

Magyarország 100%



AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	10,23 %	0,64 %
1 hónap	2,20 %	0,07 %
3 hónap	9,47 %	0,17 %
6 hónap	10,12 %	0,32 %

KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 4,09 %
A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,11 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

Ajavasolt 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