

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
Ateljes alap nettó eszközértéke:	652 088 033 HUF
Intézményi sorozat nettó eszközértéke:	644 973 443 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,018041 HUF

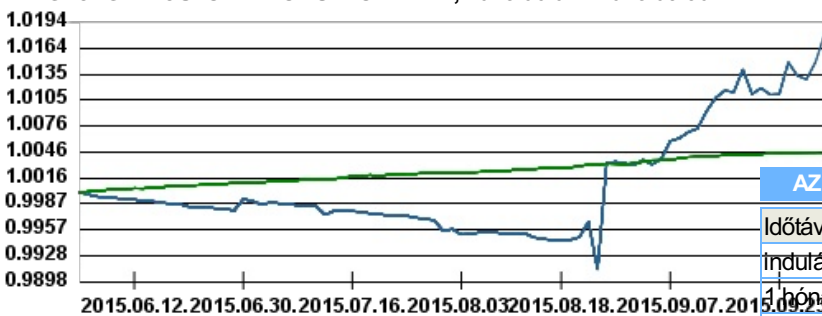
BEFEKTETÉSI POLITIKA:

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, megcélózva 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 - 2015.09.30



— 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:

Szeptember hónapban a befektetések az alacsonyabb kockázatú eszközök irányába tolódtak el. A részvénypiacokon csökkenés volt tapasztalható, ezzel szemben a kötvények felé megnőtt az érdeklődés. Az alapjaink szempontjából fontos főbb részvénypiacok árfolyamai, nagy napon belüli volatilitással estek, ami jó lehetőséget biztosított a rövid befektetési stratégiáink sikeres megvalósításához. Ahazai kötvénypiacok is az erősödés irányába mozdultak, követve a fejlett kötvénypiacok mozgását, mely erősödést az alapnak sikerült kihasználnia. A devizapiacokon csöndesebbek voltak a megelőző időszakhoz képest, az árupiaci devizák esetében tapasztaltunk hevesebb árfolyamingadozásokat, az emelkedő mezőgazdasági termékek és nemesfémek hatására.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉLE 2015.09.30

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	96,16 %
Számlapénz	7,28 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	0,05 %
Kötelezettség	-0,01 %
Állampapír repo ügyletek	-3,06 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	37,78 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	109,44 %

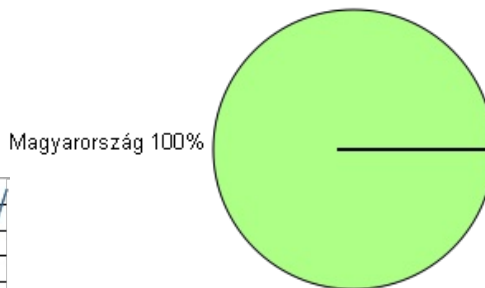
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

2018A(Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2019A(Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2021A(Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

2018A(Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2019A(Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2021A(Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

Arészvények országokénti megoszlása:



AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
Indulástól	1,80 %	0,44 %
1 hónap	1,47 %	0,12 %
3 hónap	1,89 %	0,34 %

KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 1,04 %
Abenchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,04 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

Ajavasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszakos szórása alapján:

