

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
A teljes alap nettó eszközértéke:	697 002 790 HUF
Intézményi sorozat nettó eszközértéke:	686 430 007 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,083477 HUF

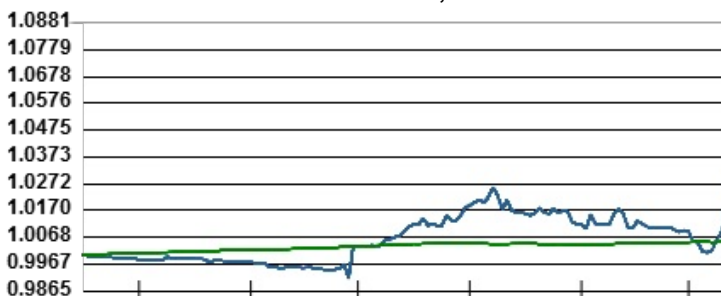
BEFEKTETÉSI POLITIKA

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 kötvénypiac és annak derivatív piacai. A Részalap emellett a globális devizapiaci 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 - 2016.01.31



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:

Az év első hónapjában folytatódott a decemberben tapasztalt árfolyamcsökkenés a részvénypiacokon. A fejlett piaci kötvények hozamai nagyon erős esésen mentek keresztül. Ennek hatására a hazai kötvénypiacok is rekord nagyságot erősödtek. A nemzetközi devizapiacokon eseménytelenül telt el a január, a forint viszont komoly volatilitás mellett ingadozott a 318 és 312-es árfolyam között.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2016.01.31

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	88,32 %
Követelés	29,36 %
Kötelezettség	-28,25 %
Számlapénz	17,79 %
Állampapír repo ügyletek	-7,24 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	0,00 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	100,00 %

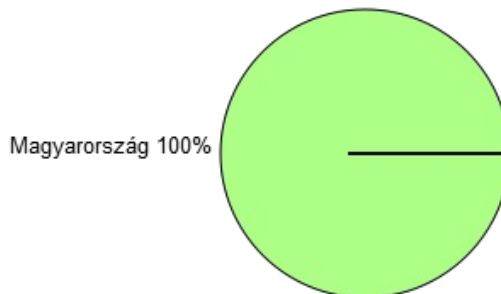
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

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.)

Arésvények országokénti megoszlása:



AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	8,35 %	0,57 %
1 hónap	5,09 %	0,03 %
3 hónap	6,57 %	0,15 %
6 hónap	8,81 %	0,34 %

KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása:	3,82 %
A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása:	0,11 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

Az alap minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszak szórása alapján:

