

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:	3 620 253 304 HUF
Intézményi sorozat nettó eszközértéke:	1 108 951 373 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,274604 HUF

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, 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 limitok 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

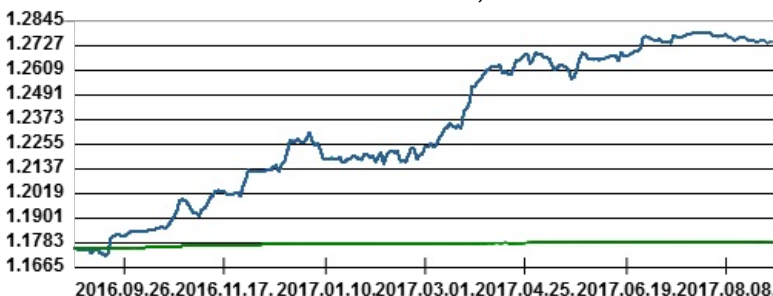
Concorde Értékpapír Zrt.

AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	11,43 %	0,62 %
2016	19,11 %	0,81 %

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2016.09.01 - 2017.08.31



— 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:

Augusztus hónapban a magyar állampapírpiac nagyon csöndes volt. Az alap nem rendelkezett nagyon pozícióval. Lényegében a teljesítménye is stagnált.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2017.08.31

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	80,05 %
Jelzáloglevelek	5,87 %
Kincstárjegyek	1,63 %
Számlapénz	13,44 %
Kötelezettség	-0,90 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	0,14 %
Követelés	0,02 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	41,88 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	109,82 %

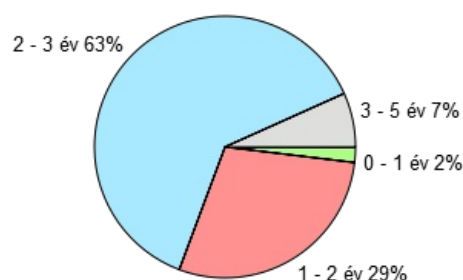
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

2020B (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2020P (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2020O (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
Erste Jelzálogkötvény_EJBFN21/A (Erste Jelzálog Bank Zrt.)

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

2020B (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2020P (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: 0,06 %

BEFKETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszaki szórása alapján:

