

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
Ateljes alap nettó eszközértéke:	647 331 696 HUF
HUF sorozat nettó eszközértéke:	7 048 377 HUF
Egyjegyre jutó nettó eszközérték:	1,006911 HUF

BEFEKTETÉSI POLITIKA:

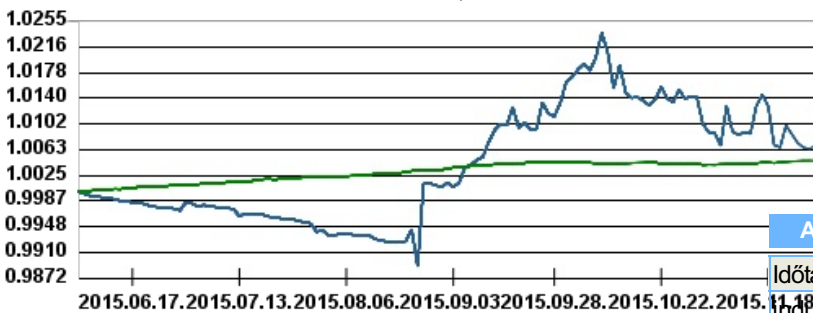
A MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap (továbbiakban: Részalap) elsődleges célja a kockázatmentes hozamál magasabb megtérülés elérése hosszú távon többlet kockázatok vállalásával, döntően kötvénybefektetések és spekulatív származtatott ügyletek segítségével. Az Alapkezelő a Részalap vagyonát abszolút hozamú szemléletben kezeli, megelőzve 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 piaci. 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.) 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 - 2015.11.30



--- 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:

Novemberben a részvény- és kötvénypiacok alacsonyabb volatilitás mellett működtek. A részvenypiacok inkább stagnáltak, a német részvényindex kissé emelkedett, míg az amerikai piacok egy hónap közepi esését követően lényegében egy helyben maradtak. A fejlett piaci kötvények kissé erősödtek, de a fejlődő piaci kötvényekre már nem hatott a hozamcsökkenési irány, így a hazai kötvénypiac sem tudott tovább erősödni.

A devizapiacok aktívak voltak, a dollár folytatta az erősödését, sőt talán egy gyorsuló szakaszba lépett, ennek megfelelően az EURUSD és az USDJPY újabb rég nem látott szintekre kerültek. A forint stabil volt az euróval szemben, míg a dollárral szemben tovább gyengül, lassan megközelítve a 2000-2001. évi szinteket. Az áru piacon az olaj tovább gyengült és az arany is komoly eladói nyomás alá került.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉLE 2015.11.30

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	96,38 %
Számlapénz	11,66 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	-0,03 %
Állampapír repo ügyletek	-7,73 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	22,64 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	111,32 %

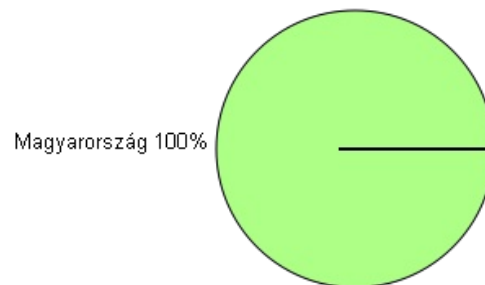
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

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.)

A részvények országokénti megoszlása:



AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
Indulástól	0,69 %	0,46 %
1 hónap	-0,73 %	0,04 %
3 hónap	0,59 %	0,15 %

KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 1,45 %

Abenchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,09 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:

<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
3 hó	6 hó	1 év	2 év	3 év	4 év	5 év

Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszak szórása alapján:

<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
nagyon alacsony	alacsony	mérsékelt	közepes	jelentős	magas	nagyon magas