

MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap C 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:	HU0000719356
Indulás:	2017.09.12
Devizanem:	HUF
A teljes alap nettó eszközértéke:	4 822 840 578 HUF
C sorozat nettó eszközértéke:	949 980 860 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,019174 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, 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 piaca 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 limitiek 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. Az "A" és "I" (forintos) sorozatok referenciahozama a ZMAX index teljesítménye, az EUR sorozaté az 1 hónapos EURIBOR kamatlábak átlaga.

FORGALMAZÓK

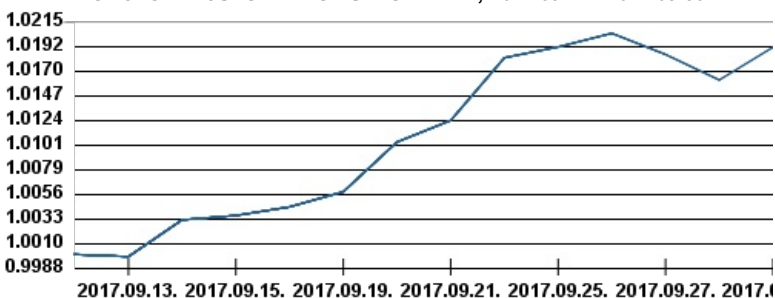
Concorde Értékpapír Zrt.

AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	1,92 %	0,02 %

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2017.09.12 - 2017.09.30



— MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap C 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:

A kötvényalap számára kedvezően alakult a szeptemberi hónap, hiszen a nyári eseménytelen időszak után a hozamgörbe ismét ereszkedni kezdett. Az alap kötvény duration túlsúlyos pozícióval használta ki a hozamcsökkenési trendet, így az alap teljesítménye több, mint 2% lett a tárgyhónapban.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉLE 2017.09.30

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	71,83 %
Vállalati és hitelintézeti kötvények	11,98 %
Jelzáloglevelek	4,43 %
Kincstárjegyek	0,62 %
Számlapénz	9,18 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	1,85 %
Kötelezettség	0,00 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	182,62 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	105,82 %

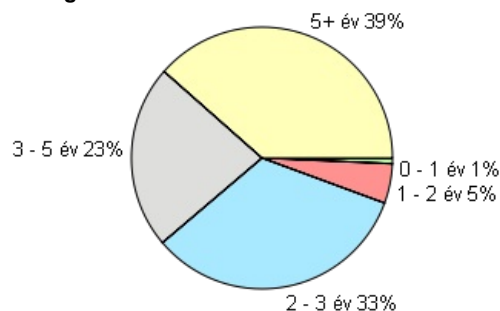
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

2024B (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2020A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2026D (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2020P (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2020C (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

2024B (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2020A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2026D (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: 1,48 %

A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,01 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:

<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input 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 időszaki szórása alapján:

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