

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: | 4 801 481 243 HUF |
| C sorozat nettó eszközértéke: | 2 062 971 277 HUF |
| Egy jegyre jutó nettó eszközérték: | 1,018806 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 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 limitiek 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 sorozatá az 1 hónapos EURIBOR kamatlábak átlaga.

FORGALMAZÓK

Concorde Értékpapír Zrt., Marketprog Asset Management Zrt.

AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

| Időtáv | Befektetési jegy | Benchmark |
|------------|------------------|-----------|
| indulástól | 1,88 % | 0,04 % |
| 1 hónap | 1,17 % | 0,02 % |
| 3 hónap | -0,51 % | 0,03 % |
| 6 hónap | -0,82 % | 0,02 % |

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2017.09.12 - 2018.07.31



— 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:

Az Alap közel 1,5%-ot erősödött az elmúlt hónapban. Július hónap elején emelkedett a portfólió értéke, mivel az Alap inkább hozamemelkedésre volt pozicionálva pay swap instrumentumokon keresztül. A hónap második felében zárt az Alap a kvázi short pozícióiból, ezt követően inkább neutrál pozíciót vett fel.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2018.07.31

| Eszköz típusa | Részarány |
|--------------------------------------|-----------|
| Államkötvények | 51,05 % |
| Kollektív értékpapírok | 4,21 % |
| Vállalati és hitelintézeti kötvények | 1,22 % |
| Számlapénz | 42,32 % |
| Nyitott derivatív pozíciók értéke | 3,03 % |
| Kötelezettség | -1,37 % |
| Követelés | 0,12 % |
| Összesen | 100,00 % |
| Származtatott ügyletek | 219,68 % |
| Nettó korrekciós tőkeáttétel | 152,07 % |

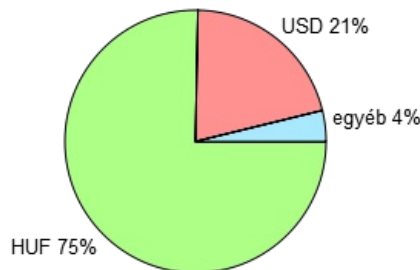
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

| |
|---|
| 2020A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.) |
| 2020P (Államadósság Kezelő Központ Zrt.) |
| 2020O (Államadósság Kezelő Központ Zrt.) |
| REPHUN 2021/03/29 6,375% USD (Államadósság Kezelő Központ Zrt.) |
| 2020B (Államadósság Kezelő Központ Zrt.) |

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

| |
|--|
| 2020A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.) |
| 2020P (Államadósság Kezelő Központ Zrt.) |

Devizánkénti megoszlás:



KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 3,10 %

A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,03 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



3 hó



6 hó



1 év



2 év



3 év



4 év



5 év

Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszaki szórása alapján:



nagyon alacsony



alacsony



mérsékelt



közepes



jelentős



magas



nagyon magas