

MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap EUR sorozat



marketprog
Asset Management

ÁLTALÁNOS INFORMÁCIÓK

Alapkezelő:	Marketprog Asset Management Zrt.
Letétkezelő:	Unicredit Bank Zrt.
Vezető forgalmazó:	Marketprog Asset Management Zrt.
Benchmark összetétele:	100% EURIBOR 1M
ISIN kód:	HU0000714548
Indulás:	2016.05.23
Devizanem:	EUR
A teljes alap nettó eszközértéke:	999 037 122 HUF
EUR sorozat nettó eszközértéke:	55 095 EUR
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	0,010048 EUR

BEFEKTETÉSI POLITIKA:

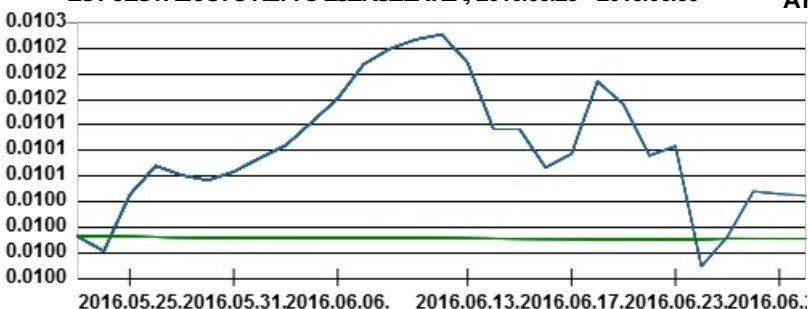
A MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap (továbbiakban: Részalap) elsődleges célja a kockázatmentes hozammal magasabb megtérülés elérése hosszú távon többlet kockázatok vállalásával, döntően kötvénybefektetések és spekulatív származtatott ügyletek segítségével. Az Alapkezelő a Részalap 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 piacai. 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. A referenziahozam a ZMAX index teljesítménye.

FORGALMAZÓK

Concorde Értékpapír Zrt.

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2016.05.23 - 2016.06.30



MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap EUR 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 június hónap piaci hangulatát teljes mértékben meghatározta az angol népszavazás az EU-ban történő maradásról-távozásról. A június 23-i szavazás eredményeképpen a távozásra voksolók aránya volt magasabb, így megtörtént az, amire igazából senki sem számított. Ennek hatására az összes eszközcsoportban rendkívül nagy mértékű árfolyaringadozást tapasztalhattunk. Június 24-e reggel a szavazási eredmény hatására a részvénypiacok zuhanni kezdtek, míg a az addig is mélypontot lévő hozamszintek tovább esettek, emellett az arany ára 100 dollárt ugrott. A devizapiacra természetesen a GBP árfolyama mutatta a legnagyobb változást, a maga -12%-os gyengülésével. Az euró gyengülése mellett a nap nyertese a japán jen volt. Az 1-2 napig tartó részvénypiaci gyengülkedést követően a piacok ismét erősödni kezdtek és az előző csúcsok közelébe ugrottak a papírok árfolyamai. A hazai állampapírok hozamszintje ismét komoly csökkenésen ment keresztül.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2016.06.30

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	61,28 %
Kincstárjegyek	19,80 %
Számlapénz	18,03 %
Követelés	0,95 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	0,63 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	69,54 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	117,38 %

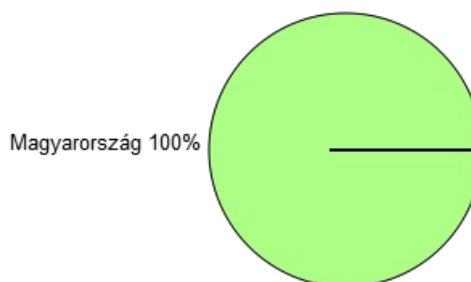
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

- 2018A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
- 2019C (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
- D160803 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
- 2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

- 2018A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
- 2019C (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
- D160803 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
- 2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

A részvények országonkénti megoszlása:



AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	0,48 %	-0,03 %
1 hónap	-0,28 %	-0,02 %

KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 2,44 %
A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,01 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszak szórása alapján:

