

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
A teljes alap nettó eszközértéke:	885 070 444 HUF
HUF sorozat nettó eszközértéke:	170 082 823 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,121872 HUF

BEFETETÉSI POLITIKA:

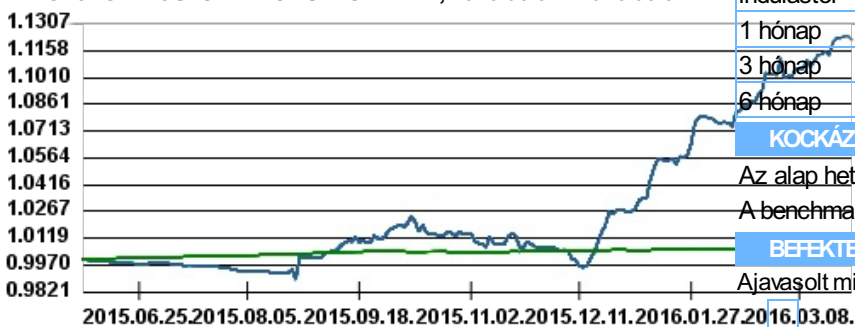
A MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap (továbbiakban: Részalap) elsődleges célja a kockázatmentes hozamnál magasabb megtérülés elérése hosszú távon többlet kockázatok vállalásával, döntően kötvénybefektetések és spekulatív származtatott ügyletek segítségével. Az Alapkezelő a Részalap 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 devizapiaci eszközeibe is befektet spekulatív vagy fedezési céllal. A Részalap a jogszabályban meghatározott limitek 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 referenciahozam a ZMAX index teljesítménye.

FORGALMAZÓK

Concorde Értékpapír Zrt.

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2015.06.04 - 2016.03.31



— 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 listával 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:

Március hónapban a hazai állampapírok hozamai tovább csökkentek, ezzel mindkét alapunk a hosszabb futamidő következtében kedvezően teljesített. A nemzetközi részvénypiacok alapvetően emelkedtek, a hazai vezető részvények árfolyamai is magasabb tartományba kerültek. A devizapiacok nagyon magas volatilitást mutattak, mely nem volt kedvező az aktív kereskedési stratégia folytatására.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2016.03.31

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	71,32 %
Számlapénz	22,22 %
Állampapír repo ügyletek	7,91 %
Követelés	0,21 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	-0,18 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	71,14 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	117,78 %

A(z) 5 legnagyobb pozíció:

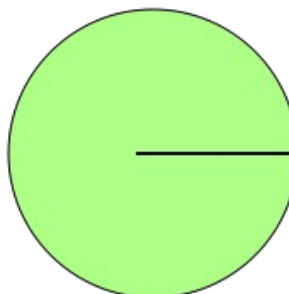
2018A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2019C (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

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

Arésztvények országokénti megoszlása:

Magyarország 100%



AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	12,19 %	0,70 %
1 hónap	1,77 %	0,06 %
3 hónap	9,23 %	0,16 %
6 hónap	10,38 %	0,26 %

KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 4,21 %
A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,12 %

BEFETETÉSI HORIZONT:

Ajavasolt minimális befektetési idő:

3 hó 6 hó 1 év 2 év 3 év 4 év 5 év

Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszak szórása alapján:

nagyon alacsony alacsony mérsékelt közepes jelentős magas nagyon magas