

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: | 999 037 122 HUF |
| HUF sorozat nettó eszközértéke: | 257 635 770 HUF |
| Egy jegyre jutó nettó eszközérték: | 1,133551 HUF |

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 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., SPB

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2015.07.01 - 2016.06.30



----- MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap HUF sorozat

----- Benchmark

A múltbéli 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 árfolyamingadozást tapasztalhattunk. Június 24-e reggel a szavazási eredmény hatására a részvénypiacok zuhanni kezdtek, míg a az addig is mélypontot lévő hozamszintek tovább esetek, 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 % |

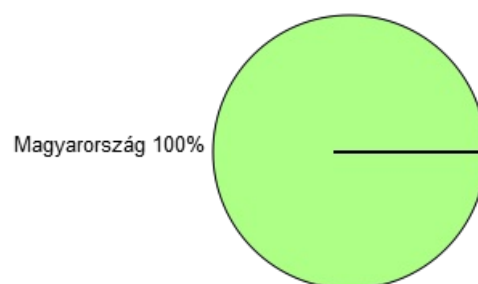
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

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 országokénti megoszlása:



AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

| Időtáv | Befektetési jegy | Benchmark |
|------------|------------------|-----------|
| indulástól | 12,41 % | 0,90 % |

KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 4,38 %

A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,12 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszak szórása alapján:

