

MARKETPROG Technics Abszolút Hozamú 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:	HU0000714571
Indulás:	2015.06.04
Devizanem:	HUF
A teljes alap nettó eszközértéke:	185 051 631 HUF
HUF sorozat nettó eszközértéke:	185 051 631 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,011562 HUF

BEFEKTETÉSI POLITIKA:

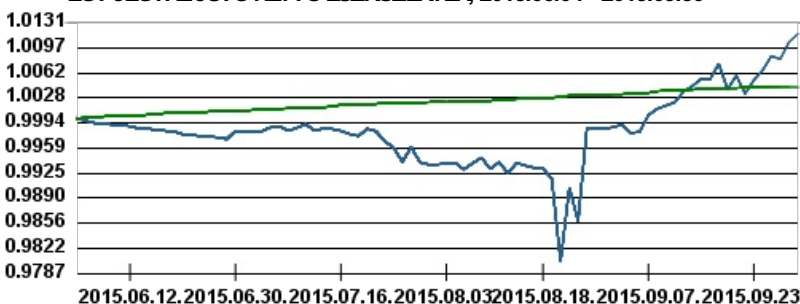
A MARKETPROG Technics Abszolút Hozamú Származtatott Részalap (továbbiakban: Részalap) elsődleges célja az éven belüli állampapírokat reprezentáló kockázatmentes hozamál magasabb megtérülés elérése hosszú távon többlet kockázatok vállalásával, döntően kötvénybefektetések és spekulatív származtatott ügyletek 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 befektetése során elsősorban a saját fejlesztésű technikai modelljeit használja a rövid- és középtávú pozícióinak kialakítása kapcsán. A potenciális befektetési terület globális és a lehető legszélesebb: hazai és nemzetközi részvények, kötvények, bankbetétek és Pénzpiaci eszközök, származtatott ügyletek. 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 referenciahozama ZMAX index teljesítménye.

FORGALMAZÓK

Concorde Értékpapír Zrt.

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2015.06.04 - 2015.09.30



MARKETPROG Technics Abszolút Hozamú Származtatott Részalap HUF s

----- 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.

KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 2,43 %

A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,04 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszaki szórása alapján:



PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

Szeptember hónapban a befektetések az alacsonyabb kockázatú eszközök irányába tolódtak el. A részvény piacokon csökkenés volt tapasztalható, ezzel szemben a kötvények felé megnőtt az érdeklődés.

Az alapjaink szempontjából fontos főbb részvény piacok árfolyamai, nagy napon belüli volatilitással estek, ami jó lehetőséget biztosított a rövid befektetési stratégiáink sikeres megvalósításához. A hazai kötvény piacok is az erősödés irányába mozdultak, követve a fejlett kötvény piacok mozgását, mely erősödést az alapnak sikerült kihasználnia.

A devizapiacokon csöndesebbek voltak a megelőző időszakhoz képest, az árupiaci devizák esetében tapasztaltunk hevesebb árfolyamingadozásokat, az emelkedő mezőgazdasági termékek és nemesfémek hatására.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2015.09.30

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	35,62 %
Kincstárjegyek	27,55 %
Egyéb eszközök	4,22 %
Számlapénz	33,11 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	0,02 %
Kötelezettség	-0,01 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	29,90 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	109,93 %

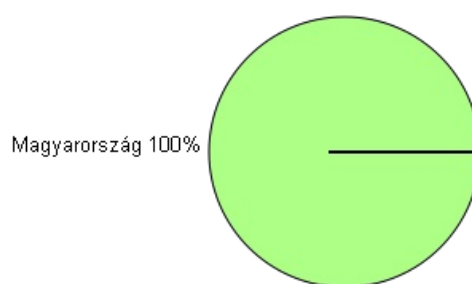
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D151111 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2021A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D151104 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
Magyar Telekom

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D151111 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2021A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D151104 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

Arészvények országokénti megoszlása:



AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	1,16 %	0,43 %
1 hónap	1,31 %	0,11 %
3 hónap	1,33 %	0,32 %