

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:	269 427 479 HUF
HUF sorozat nettó eszközértéke:	269 427 479 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,015701 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., SFB

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2015.08.01 - 2016.07.31



PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

A július hónap alapvetően pozitív hangulatban telt, mind a világ részvénypiacai, mind a kötvénypiacok erőteljes emelkedésen mentek keresztül. Elsősorban a júniusban tapasztalt nagy árfolyamesés és magas volatilitás visszarendeződésének lehettünk tanúi. A devizapiacokon a dollár csöndes volt az euróval, szemben, míg a jen ismét gyengülni tudott. A forint jelentősen erősödött, ismét 312 alatt zárta a hónapot. A hazai kötvénypiac is sokat erősödött, a magyar hozamgörbe a lengyel hozamgörbe alá esett.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2016.07.31

Eszköz típusa	Részarány
Kincstárjegyek	48,65 %
Államkötvények	40,71 %
Számlapénz	11,25 %
Kötelezettség	0,00 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	-0,62 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	64,26 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	144,99 %

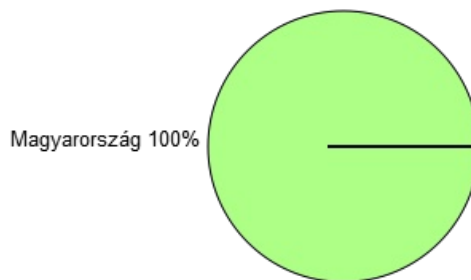
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

D170524 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D170316 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2020A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D160803 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

D170524 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D170316 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2020A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

Arészenyek országokénti megoszlása:



AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	1,36 %	0,96 %

MARKETPROG Technics Abszolút Hozamú 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 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: 3,70 %

A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,13 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszak szórása alapján:

