

# 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:	268 125 698 HUF
HUF sorozat nettó eszközértéke:	268 125 698 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,026269 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 dinamikus alakítja ki a különböző eszközcsoportok súlyát a piaci helyzet és a követett stratégia függvényében. Az Alapkezelő befektetési 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, 2015.09.01 - 2016.08.31



## 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: 3,53 %

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

## BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszaki szórása alapján:



## PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

Augusztus hónapban a folytatódott az elmúlt hónapokban tapasztalt erősödés. A kötvénypiacok és részvénytőzsdék további emelkedést könyvelhettek el, de az emelkedés dinamikája csökkent. A befektetők az 1-2 napig tartó korrekcióra még inkább vásárlással reagáltak, de újabb csúcspontokat már nem értek el az árfolyamok. A hazai kötvénypiac a júliusi nagy hozamcsökkenést követően augusztusban kis mértékben ugryn, de még erősödni tudott. A forint tovább szárnyalt és megközelítette a 308-es szintet az euróval szemben, mely szint az eddigiekben lényegében a sáv alját képviselte.

## AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2016.08.31

Eszköz típusa	Részarány
Kincstárjegyek	49,41 %
Államkötvények	41,15 %
Számlapénz	10,01 %
Kötelezettség	0,00 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	-0,08 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	15,16 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	106,34 %

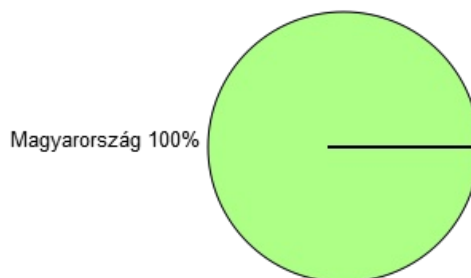
## A(z) 5 legnagyobb pozíció:

D170524 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2020A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D170316 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D170719 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

## 10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

D170524 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2020A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D170316 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D170719 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

## A részvények országokénti megoszlása:



## AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	2,11 %	0,92 %