

MARKETPROG Technics Abszolút Hozamú Származtatott Részalap HUF sorozat



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:	295 336 274 HUF
HUF sorozat nettó eszközértéke:	295 336 274 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,016923 HUF

BEFEKTETÉSI POLITIKA:

A MARKETPROG Technics Abszolút Hozamú Származtatott Részalap (továbbiakban: Részalap) elsődleges célja az éven belüli állampapírokat reprezentáló 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 befektetéseit 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 forintos sorozat referenciahozam a ZMAX index teljesítménye, az EUR sorozat az 1 hónapos EURIBOR kamatlábak átlaga.

FORGALMAZÓK

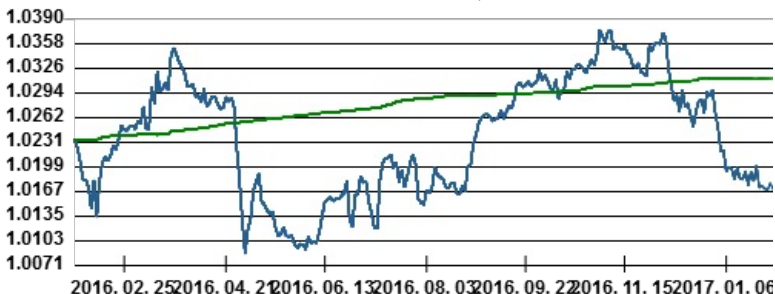
Concorde Értékpapír Zrt., Erste Befektetési Zrt., SPB

AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	1,02 %	0,81 %
2016	1,37 %	0,81 %

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2016.02.01 - 2017.01.31



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.

PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

Az év első hónapjában a piaci volatilitás meglehetősen alacsony volt. A részvényindexek a fejlett piacokon egy szűkebb sávban mozogtak, míg a kötvénypiacok inkább egy óvatos oldalazással folytatták pályájukat. A devizapiacokon a dollár egy korrekcióval gyengülni kezdett az euróval szemben, megérintve az 1,08-as szintet. A forint nyugodt, pár forintos sávban mozgott. A hazai kötvénypiac nem adott sok lehetőséget a kereskedésre, a hozamgörbe alakja meredekebb lett, erre a mozgásra lehetett pozíciókat felépíteni, melyek az elkövetkező időszakban pozitív teljesítményt nyújthatnak az alapnak.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2017.01.31

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	36,93 %
Kincstárjegyek	35,21 %
Számlapénz	28,29 %
Követelés	0,02 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	-0,11 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	25,63 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	112,81 %

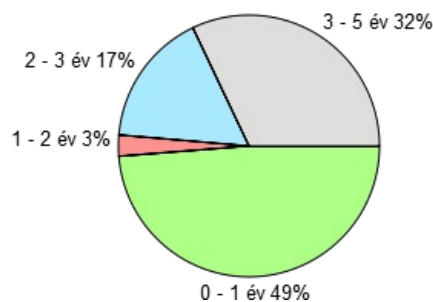
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

- D170524 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
- 2020A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
- 2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
- D170719 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
- 2021A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

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

Lejárat szerinti megoszlás:



KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 3,21 %
A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,09 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszaki szórása alapján:

