

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:	224 738 702 HUF
HUF sorozat nettó eszközértéke:	224 738 702 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,015860 HUF

BEFEKTETÉSI POLITIKA:

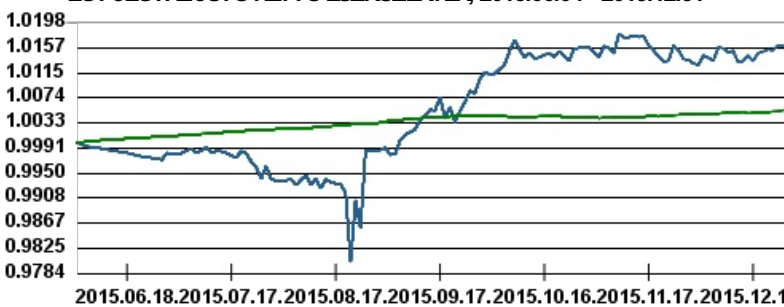
A MARKETPROG Technics Abszolút Hozamú Származtatott Részalap (továbbiakban: Részalap) elsődleges célja az éven belüli állampapírokat reprezentáló kockázatmentes hozamál magasabb megtérülés elérése hosszú távon többlet kockázatok vállalásával, döntően kötvénybefektetések és spekulatív származtatott ügyletek 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 - 2015.12.31



MARKETPROG Technics Abszolút Hozamú Származtatott Részalap HUF s

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: 2,52 %

A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,10 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszak szórása alapján:



PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

Az év utolsó hónapja rendkívül mozgalmasan telt minden eszközcsoport esetében. A részvénypiacok az októberi és novemberi emelkedést visszaadva a hónap közepéig estek, majd év végére némi korrekciót bemutatva zárták az évet. A német index az tavalyi évben így 9,6%-kal erősödött, míg az amerikai piac lényegében nulla változást mutatott az év elejéhez képest.

A kötvények esetében két részre bontható a december, mivel a hónap első két hetében masszív hozamemelkedés, majd erős hozamcsökkenés volt tapasztalható. A hónap első két hete a fő piacok mellett a fejlődő piacokat is megbillentette, ez volt érzékelhető a hazai kötvénypiacokon is hozamemelkedés formájában, de a decemberi végi zárás végül kedvezőbben alakult.

A nyersanyagok esetében, decemberben az arany stagnált, de az olajban ismét 40 dollár alá érkezünk és ez a csökkenő trend egész hónapban kitartott.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2015.12.31

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	29,01 %
Kincstárjegyek	26,71 %
Állampapír repo ügyletek	36,54 %
Számlapénz	8,24 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	0,04 %
Kötelezettség	0,00 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	0,65 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	100,65 %

A(z) 5 legnagyobb pozíció:

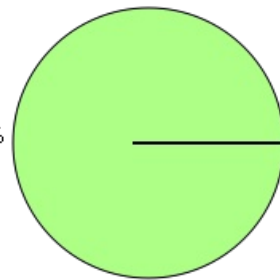
D160608 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2021A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2018A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

D160608 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2021A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

A részvények országokénti megoszlása:

Magyarország 100%



AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	1,59 %	0,54 %
1 hónap	0,28 %	0,07 %
3 hónap	0,42 %	0,10 %
6 hónap	1,76 %	0,44 %