

# 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:	268 258 070 HUF
HUF sorozat nettó eszközértéke:	268 258 070 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,031918 HUF

## BEFEKTETÉSI POLITIKA:

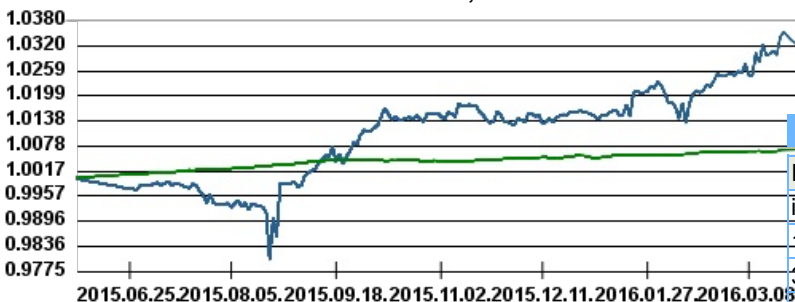
A MARKETPROG Technics Abszolút Hozamú Származtatott Részalap (továbbiakban: Részalap) elsődleges célja az éven belüli állampapírokat reprezentáló kockázatmentes hozamál magasabb megtérülés elérése hosszú távon többlet kockázatok vállalásával, döntően kötvénybefektetések és spekulatív származtatott ügyletek 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 befektetései 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 - 2016.03.31



## PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

Március hónapban a hazai állampapírok hozamai tovább csökkentek, ezzel mindkét alapunk a hosszabb futamidő következtében kedvezően teljesített. A nemzetközi részvénypiacok alapvetően emelkedtek, a hazai vezető részvények árfolyamai is magasabb tartományba kerültek. A devizapiacok nagyon magas volatilitást mutattak, mely nem volt kedvező az aktív kereskedési stratégia folytatására.

## AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2016.03.31

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	41,53 %
Kincstárjegyek	36,57 %
Számlapénz	15,49 %
Állampapír repo ügyletek	6,71 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	0,26 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	41,18 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	117,91 %

## A(z) 5 legnagyobb pozíció:

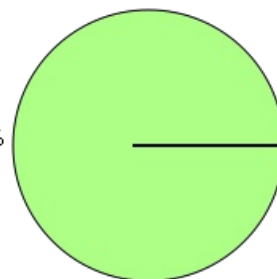
D160608 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2020A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D160420 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2021A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

## 10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

D160608 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2020A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D160420 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

## A részvények országokénti megoszlása:

Magyarország 100%



## AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
Indulástól	3,19 %	0,70 %
1 hónap	0,67 %	0,06 %
3 hónap	1,58 %	0,16 %
6 hónap	2,01 %	0,26 %

## 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: 2,70 %

A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,12 %

## BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszaki szórása alapján:

