

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:	265 893 667 HUF
HUF sorozat nettó eszközértéke:	265 893 667 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,018592 HUF

BEFEKTETÉSI POLITIKA:

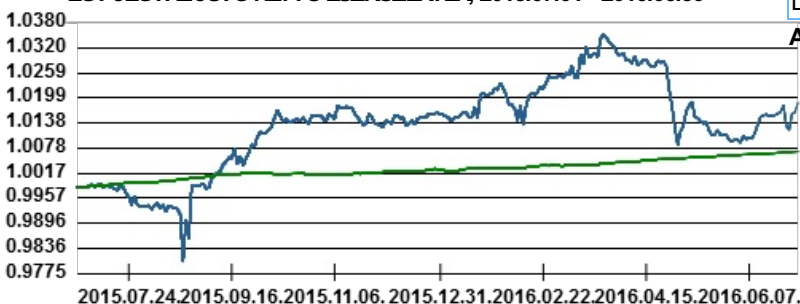
A MARKETPROG Technics Abszolút Hozamú Származtatott Részalap (továbbiakban: Részalap) elsődleges célja az éven belüli állampapírokat reprezentáló kockázatmentes hozamál magasabb megtérülés elérése hosszú távon többlet kockázatok vállalásával, döntően kötvénybefektetések és spekulatív származtatott ügyletek 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, 2015.07.01 - 2016.06.30



PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

A június hónap piaci hangulatát teljes mértékben meghatározta az angol népszavazás az EU-ban történő maradásról-távozásról. A június 23-i szavazás eredményeképpen a távozásra voksolók aránya volt magasabb, így megtörtént az, amire igazából senki sem számított. Ennek hatására az összes eszközosztályban rendkívül nagy mértékű árfolyamingadozást tapasztalhattunk. Június 24-e reggel a szavazási eredmény hatására a részvénytőkepiacok zuhanni kezdtek, míg a az addig is mélypontot lévő hozamszintek tovább esettek, emellett az arany ára 100 dollárt ugrott. A devizapiacra természetesen a GBP árfolyama mutatta a legnagyobb változást, a maga -12%-os gyengülésével. Az euró gyengülése mellett a nap nyertese a japán jen volt. Az 1-2 napig tartó részvénypiaci gyengüléskövetően a piacok ismét erősödni kezdtek és az előző csúcspontok közelébe ugrottak a papírok árfolyamai. A hazai állampapírok hozamszintje ismét komoly csökkenésen ment keresztül.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2016.06.30

Eszköz típusa	Részarány
Kincstárjegyek	51,59 %
Államkötvények	41,00 %
Számlapénz	10,34 %
Kötelezettség	-2,29 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	-0,28 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	22,77 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	114,75 %

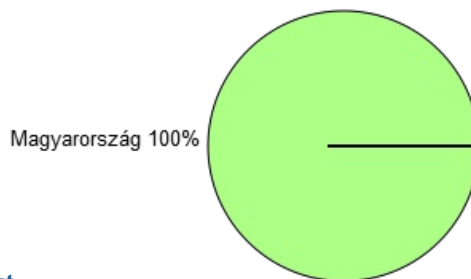
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

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.)
D160803 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

A részvények országokénti megoszlása:



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: 3,67 %

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

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszakos szórása alapján:



AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	1,73 %	0,90 %