

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:	111 142 502 HUF
HUF sorozat nettó eszközértéke:	111 142 502 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	0,952558 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, 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 befektetéseit 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 Pénzügyi 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 fontos sorozat referenciahozam a ZMAX index teljesítménye, az EUR sorozat az 1 hónapos EURIBOR kamatlábak átlaga.

FORGALMAZÓK

Concorde Értékpapír Zrt., Erste Befektetési Zrt., Marketprog Asset Management Zrt., SPB

AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	-1,87 %	0,56 %
2017	-7,50 %	0,11 %
2016	1,37 %	0,81 %

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2017.01.01 - 2017.12.31



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 alap december hónapban elsősorban az EURUSD napi kereskedési startégiját folytatta. A teljesítmény tárgy hónapban kis mértékben negatív irányba változott.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2017.12.31

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	57,71 %
Számlapénz	42,00 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	0,28 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	138,91 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	134,73 %

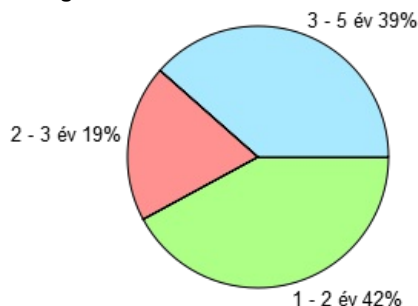
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

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

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

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

Lejárat szerinti megoszlás:



KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 4,26 %
A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,03 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszak szórása alapján:

