

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:	257 879 352 HUF
HUF sorozat nettó eszközértéke:	257 879 352 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,013794 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 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 forintos sorozat referenciahozam a ZMAX index teljesítménye, az EUR sorozat az 1 hónapos EURIBOR kamatlábak átlaga.

FORGALMAZÓK

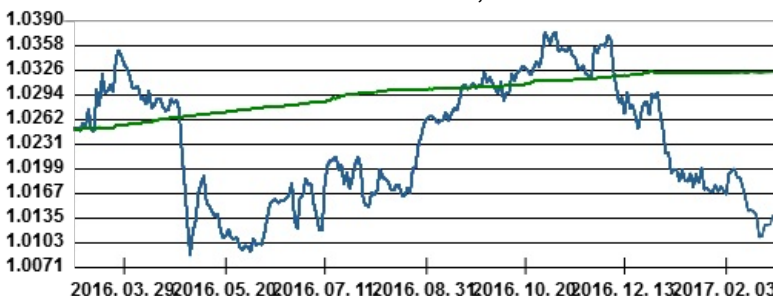
Concorde Értékpapír Zrt., Erste Befektetési Zrt., SPB

AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	0,79 %	0,78 %
2016	1,37 %	0,81 %

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2016.02.29 - 2017.02.28



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:

Februárban a nemzetközi kötvénypiacok szűk 20-30 hozam-bázisponthoz oldalazó mozgással erősítették meg az előző hónapokban tapasztalt emelkedést. A hazai kötvénypiac gyengébb volt, elsősorban a hozamgörbe hosszabb végén, a 10-15 éves tartományban hozamemelkedés következett be. A görbe rövid futamidejű részében jelentősebb mozgás nem volt.

A nemzetközi részvénypiacokon további árfolyamemelkedés tanúi lehettünk, az amerikai piac többet emelkedett az európai piacnál. A hazai részvénypiac speciális mozgást hajtott végre, mivel csak a hónap 3. hetéig követte a nemzetközi piacokat, az utolsó héten 2000 pontos szakadással zárta februárt.

A dollár kissé erősödött a többi főbb devizával szemben, míg a forint stabil maradt az euróval szemben.

Az alap február hónapban elsősorban short pozíciók kiépítésével próbálkozott a nemzetközi részvényindex futures termékekben.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2017.02.28

Eszköz típusa	Részarány
Kincstárjegyek	63,57 %
Államkötvények	42,34 %
Kötelezettség	-11,76 %
Számlapénz	6,49 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	-0,25 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	44,55 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	132,91 %

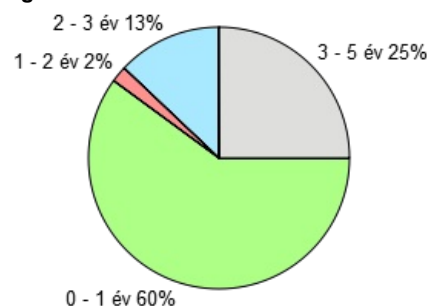
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

D170524 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
 D170913 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
 2020A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
 2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
 D170719 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

D170524 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
 D170913 (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: 3,15 %
 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:

