

MARKETPROG Technics Abszolút Hozamú Származtatott Részalap

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:	191 338 447 HUF
HUF sorozat nettó eszközértéke:	191 338 447 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,009030 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 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 fontos sorozat referenciahozam a ZMAX index teljesítménye, az EUR sorozat az 1 hónapos EURIBOR kamatlábak átlaga.

FORGALMAZÓK

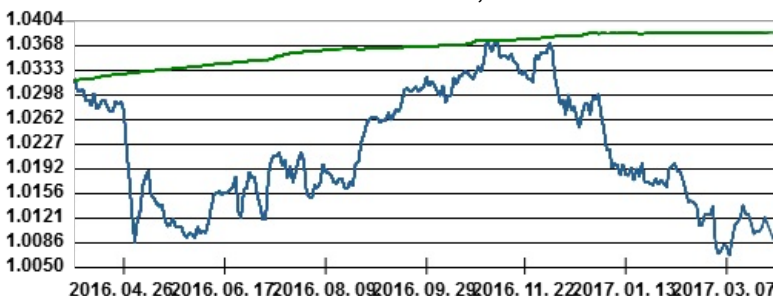
Concorde Értékpapír Zrt., Erste Befektetési Zrt., SPB

AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	0,49 %	0,75 %
2016	1,37 %	0,81 %

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2016.04.01 - 2017.03.31



— 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 alapon a rövid távú kereskedési stratégia keretei között EURUSD, USDJPY és DAX, NASDAQ index long-short pozíciókkal operáltunk. Az alapkezelő március elején próbálkozott részvényindex short pozíció kiépítésével, de stop loss szintünk elérése során a pozíciókat lezártuk.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2017.03.31

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	57,51 %
Kincstárjegyek	44,41 %
Egyéb eszközök	6,27 %
Kötelezettség	-40,52 %
Számlapénz	32,91 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	0,00 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	99,99 %

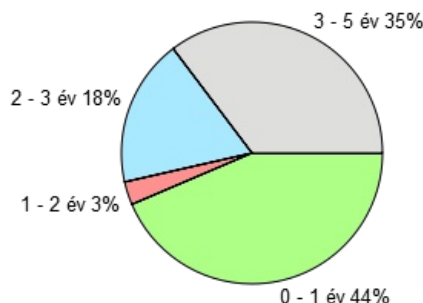
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

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

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

2020A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D170719 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D170913 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D170524 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2021A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

Lejárat szerinti megoszlás:



KOCKÁZATI MUTATÓK AZ ELMÚLT 12 HÓNAPRA:

Az alap heti hozamokból számolt évesített szórása: 3,14 %

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:

