

# 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:  | 93 586 781 HUF                   |
| HUF sorozat nettó eszközértéke:    | 93 586 781 HUF                   |
| Egy jegyre jutó nettó eszközérték: | 0,998259 HUF                     |

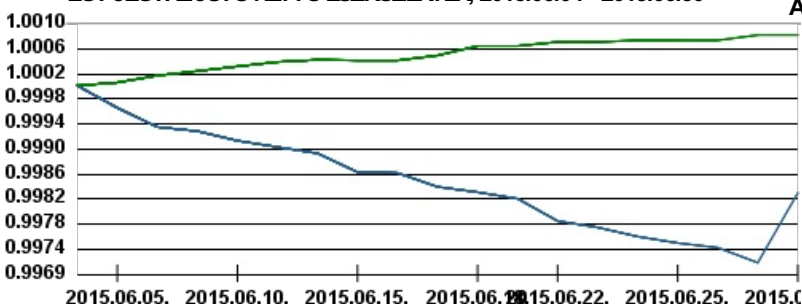
## BEFEKTETÉSI POLITIKA:

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 7/2014. (III. 14.) Korm. rendelet szerinti korrekció nélkül számított értéken figyelembe vett nettó eszközérték nyolcszorosát. A referenciahozama ZMAX index teljesítménye.

## FORGALMAZÓK

### AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

#### EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2015.06.04 - 2015.06.30



### 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: 0,01 %

A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,02 %

## BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszak szórása alapján:



## PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

Június hónapban folytatódott a májusban már elkezdődött kockázatsökkentési folyamat a befektetők részéről.

A hosszabb futamidejű fejlett piaci kötvényekhozamok emelkedtek, ezzel párhuzamosan a fejlődő piaci kötvényinstrumentumok szintén vesztek az értékükből.

A részvénypiacok szintén a gyengeség jeleit mutatták, júliusban már kifejezetten megerősítésre talált a főbb indexek esési hajlandósága.

Természetesen a júliusi esésel egyik legfőbb mozgatórugója a görög pénzügyi válsággal áll összefüggésben, melynek kimenetelét igen nehéz megjósolni, ezért befektetői oldalon egy óvatos, konzervatív befektetési stílus eredményez. A piacok volatilitása jelentősen emelkedett, mely kockázatkezelési szempontból is sok befektetőt a biztonságosabb rövid futamidejű államkötvények irányába terelte.

## AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2015.06.30

| Eszköz típusa                | Részarány |
|------------------------------|-----------|
| Kincstárjegyek               | 91,76 %   |
| Államkötvények               | 52,89 %   |
| Kötelezettség                | -52,80 %  |
| Számlapénz                   | 8,31 %    |
| Összesen                     | 100,00 %  |
| Származtatott ügyletek       | 0,00 %    |
| Nettó korrekciós tőkeáttétel | 100,17 %  |

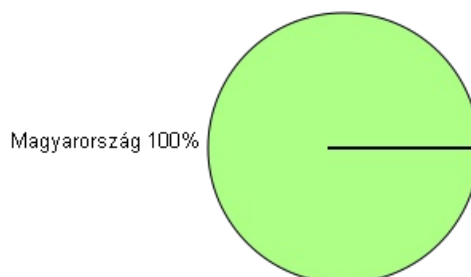
## A(z) 5 legnagyobb pozíció:

D150729 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)  
D150909 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)  
D151111 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)  
2018D (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)  
2021A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

## 10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

D150729 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)  
D150909 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)  
D151111 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)  
2018D (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)  
2021A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

## A részvények országokénti megoszlása:



## AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

| Időtáv     | Befektetési jegy | Benchmark |
|------------|------------------|-----------|
| indulástól | -0,17 %          | 0,08 %    |