

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:	223 891 903 HUF
HUF sorozat nettó eszközértéke:	223 891 903 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,013053 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.

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2015.06.04 - 2015.11.30



PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

Novemberben a részvény- és kötvénypiacok alacsonyabb volatilitás mellett működtek. A részvénypiacok inkább stagnáltak, a német részvényindex kissé emelkedett, míg az amerikai piacok egy hónap közepi esést követően lényegében egy helyben maradtak. A fejlett piaci kötvények kissé erősödtek, de a fejlődő piaci kötvényekre már nem hatott a hozamcsökkenési irány, így a hazai kötvénypiac sem tudott tovább erősödni.

A devizapiacok aktívak voltak, a dollár folytatta az erősödését, sőt talán egy gyorsuló szakaszba lépett, ennek megfelelően az EURUSD és az USDJPY újabb rég nem látott szintekre kerültek. A forint stabil volt az euróval szemben, míg a dollárral szemben tovább gyengült, lassan megközelítve a 2000-2001. évi szinteket. Az áru piacon az olaj tovább gyengült és az arany is komoly eladói nyomás alá került.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2015.11.30

Eszköz típusa	Részarány
Kincstárjegyek	69,24 %
Államkötvények	29,32 %
Számlapénz	12,48 %
Kötelezettség	-10,35 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	-0,25 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	33,36 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	132,37 %

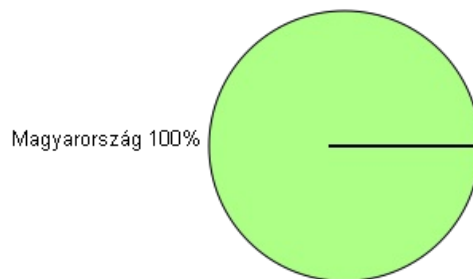
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

D151223 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
 D160608 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
 2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
 D151230 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
 2021A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

D151223 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
 D160608 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
 2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
 D151230 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
 2021A (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: 2,50 %

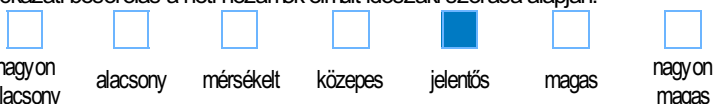
A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,09 %

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	1,31 %	0,46 %
1 hónap	-0,26 %	0,04 %
3 hónap	1,45 %	0,15 %