

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:	270 871 306 HUF
HUF sorozat nettó eszközértéke:	270 871 306 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,009808 HUF

BEFEKTETÉSI POLITIKA:

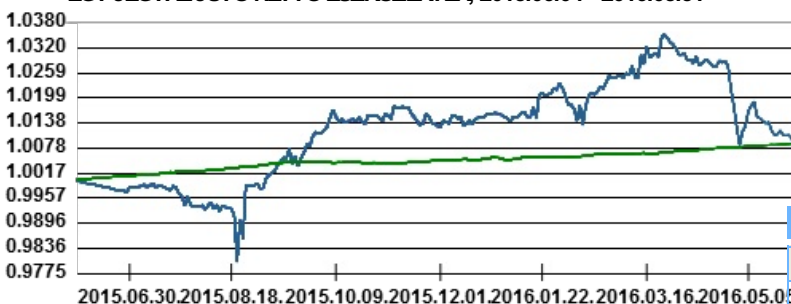
A MARKETPROG Technics Abszolút Hozamú Származtatott Részalap (továbbiakban: Részalap) elsődleges célja az éven belüli állampapírokat reprezentáló kockázatmentes hozamál magasabb megtérülés elérése hosszú távon többlet kockázatok vállalásával, döntően kötvénybefektetések és spekulatív származtatott ügyletek 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 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., SFB

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2015.06.04 - 2016.05.31



MARKETPROG Technics Abszolút Hozamú Származtatott Részalap HUF sorozat

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: 3,62 %

A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,12 %

BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszak szórása alapján:



PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

Május hónapban a nemzetközi kötvény és részvénypiacok csak kis mozgást produkáltak. A főbb piacok esetében kizárólag a devizák mutattak magasabb volatilitást, az EURUSD közel 500 pontos esésen ment keresztül.

A hazai kötvénypiac is lényegesen csöndesebb volt az mozgalmas április után, kis mértékű hozamemelkedés következett be. A kötvények gyengülésével párhuzamosan megérkezett a forint gyengülése is, május közepén 316-318 közötti sávban kereskedtek az euróval szemben.

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2016.05.31

Eszköz típusa	Részarány
Kincstárjegyek	50,89 %
Államkötvények	40,85 %
Számlapénz	8,73 %
Kötelezettség	0,00 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	-0,06 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	40,68 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	121,41 %

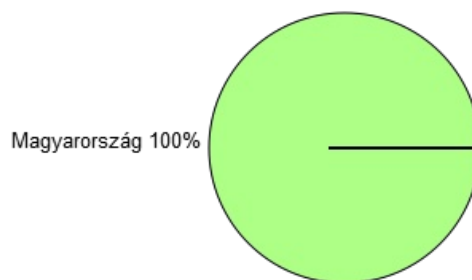
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

D160608 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D170316 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2020A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D160803 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

D160608 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D170316 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2020A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
D160803 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

Arészvények országokénti megoszlása:



AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
Indulástól	0,98 %	0,88 %
1 hónap	-0,28 %	0,08 %
3 hónap	-1,48 %	0,24 %
6 hónap	-0,32 %	0,41 %