

# 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:	163 194 499 HUF
HUF sorozat nettó eszközértéke:	163 194 499 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	0,993605 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 Pénzügyi 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 forint 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	-0,31 %	0,67 %
2016	1,37 %	0,81 %

### AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

#### EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2016.07.01 - 2017.06.30



### 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.

### PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

A Technics alap június hónapban tartotta az amerikai S&P500 index short pozícióját. Az EURUSD és USDJPY devizákban nyitott pár napos időtávra pozíciókat. Az Alap teljesítménye -0,22% volt a tárgyhónapban. Az Alapkezelő továbbra is hisz abban, hogy a piac kockázatvállalási hajlandósága csökkenni fog, így a részvénypiac a jelenlegi szintről alacsonyabb régióba eshet.

### AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2017.06.30

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	66,65 %
Számlapénz	34,24 %
Kötelezettség	-0,38 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	-0,20 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	85,17 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	166,85 %

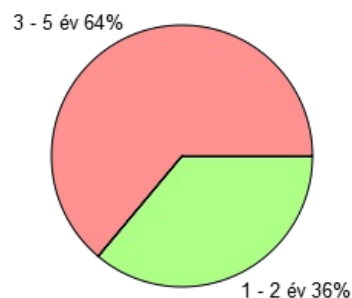
### A(z) 5 legnagyobb pozíció:

2020A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2021A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2018A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

### 10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

2020A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)
2019A (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: 2,34 %

A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,08 %

### BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



3 hó 6 hó 1 év 2 év 3 év 4 év 5 év

Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszaki szórása alapján:



nagyon alacsony alacsony mérsékelt közepes jelentős magas nagyon magas