

# 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:	249 119 993 HUF
HUF sorozat nettó eszközértéke:	249 119 993 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,031052 HUF

## BEFEKTETÉSI POLITIKA:

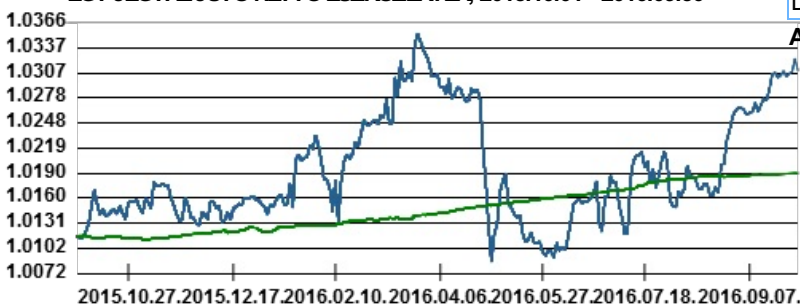
A MARKETPROG Technics Abszolút Hozamú Származtatott Részalap (továbbiakban: Részalap) elsődleges célja az éven belüli állampapírokat reprezentáló kockázatmentes hozamál magasabb megtérülés elérése hosszú távon többlet kockázatok vállalásával, döntően kötvénybefektetések és spekulatív származtatott ügyletek 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 dinamikus 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, 2015.10.01 - 2016.09.30



## PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

Szeptemberben a nemzetközi részvénypiacokon oldalazó mozgást láthattunk, a nyár óta tapasztalt alacsony volatilitás tovább folytatódott. A nemzetközi fejlett kötvénypiacok hozamai emelkedésnek indultak a megszellőztetett esetleges kamatemelés miatt. Az amerikai FED és az európai ECB mind jobban abba az irányba tesz nyilatkozatokat, hogy a jelenlegi rendkívül alacsony kamatszintek hosszabb távon nem fenntarthatóak és károsak a gazdaság hosszabb távú fejlődésére.

A fejlődő piacok kicsit jobban teljesítettek, mind a vezető piacok, mind a részvények, mind a kötvények tekintetében. A hazai kötvénypiacon még mindig hozamsökkenést tapasztalhattunk, de ennek dinamikájában és pályájában már láthattunk törést.

A forint tovább erősödött és a 310-es euróval szembeni árfolyam tartományban komfortosan érezte magát, ami további erősödést vetíthet előre.

## AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2016.09.30

Eszköz típusa	Részarány
Kincstárjegyek	46,79 %
Államkötvények	44,48 %
Számlapénz	11,49 %
Kötelezettség	-2,03 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	-0,11 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	12,43 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	112,43 %

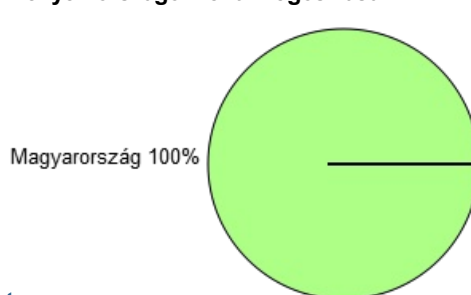
## A(z) 5 legnagyobb pozíció:

D170524 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)  
2020A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)  
2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)  
D170719 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)  
D170316 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

## 10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

D170524 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)  
2020A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)  
2019A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)  
D170719 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)  
D170316 (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: 3,03 %

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

## 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 időszak szórása alapján:



nagyon alacsony alacsony mérsékelt közepes jelentős magas nagyon magas

## AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	2,34 %	0,89 %