

## Oázis 77 Származtatott Nyíltvégű Befektetési Alap PORTFOLIÓ JELENTÉS

2011. szeptember

### Alapadatok

Letétkezelő: Erste Bank Hungary Zrt.  
Könyvvizsgáló: Gyimesi és Társa Kft..  
Vezető Forgalmazó: Buda-Cash Brókerház Zrt.  
Forgalmazók: Equilor Bef. Zrt., Codex Értéktár Zrt.  
Kibocsátás időpontja: 2010.07.28  
Nyilvántartásba vételi szám: 1111-110  
ISIN kód: HU0000708995  
NEÉ számítás típusa: T+2 napra számolt.  
Az alap devizaneme: HUF

### Befektetési Politika:

Az Alap az átlagosnál lényegesen magasabb kockázatot felvállalva, rövid- és középtávú pozíciókat vesz fel a lehető legszélesebb spektrumú piacokon. Ez magában foglalja a nemzetközi részvény, határidős, devizapiacokat. Az Alap elsődleges célpiacát olyan – külföldi kibocsátású – részvények, ETF-ek stb. jelentik, amelyek a legnagyobb forgalmú nemzetközi tőzsdék elektronikus piacain kiemelkedő forgalommal, likviditással rendelkeznek, azaz amelyekre nézve a hatékony tőkepiac feltételei leginkább teljesülnek. Amikor az Alapkezelő sehol sem lát jó hozam/kockázat lehetőséget, rövid hátralévő futamidejű állampapírokat is vásárolhat.

Az Alap szokásosnál magasabb kockázatának oka, hogy a származtatott alapok a jogszabály által megengedett, saját tőkéjükre vetített maximum kétszeres tőkeáttételt is felvehetnek, amely lehetőséggel az Alapkezelő indokolt piaci helyzetekben – szigorú kockázatkezelési szabályokat betartva – élni is kíván. Az Alap célja, hogy piaci szituációtól függetlenül jelentős hozamot biztosítson, megvalósítsa az abszolút hozam koncepcióját. Ezért az Alap előtt nyitva áll a short pozíciók nyitásának lehetősége, az árfolyamcsökkenésen való nyereség elérése.

Saját tőke / Nettóeszközérték ( 2011.10.04): 244 467 836

Egy jegyre jutó nettó eszközérték ( 2011.10.04): 0,799775

Befektetési jegyek darabszáma: 305 670 604

### A portfolió összetétele T napon

Befektetési Eszközök	HUF	NEÉ százalékában
Folyószámla	35 816 433	14.65
Folyószámla USD	126 999 802	51.95
Folyószámla EUR	92 395 213	37.79
Nyitott határidős ügyletek eredménye	15 241 357	6.23

Kötelezettségek halmozott	HUF	NEÉ százalékában
Alapkezelői díj	179 371	-0.07
Letétkezelési díj	82 181	-0.03
Felügyeleti díj	11 741	0
Forgalmazói díj	939 185	-0.38
Egyéb díj költség	25 049 465	-10.24

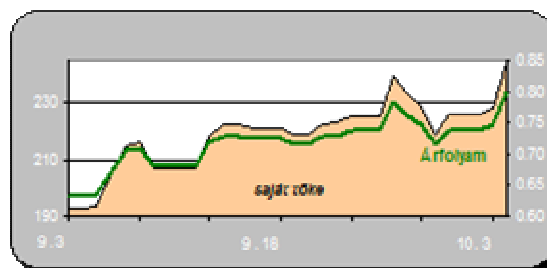
Az alap hiteltartozása kamatokkal együtt: -

Az alap által óvadékba adott eszközök: -

### Az alap teljesítménye:

Tárgyhavi hozam	Éves hozam
26.37	-4.33

### Az alap nettó eszközérték és az egy jegyre jutó nettó eszközérték változása 2011. szeptember hónapban



Megjegyzés: A nettó eszközérték és a portfolió összetétel különbsége a megkötött de még el nem számolt ügyletek, és a forgalmazási számla egyenlege miatt jön létre.

A portfoliójelentés auditálatlan (a könyvvizsgáló által nem ellenőrzött) adatokat tartalmaz.

A múltbeli hozamok az Alap jövőbeli teljesítményére nem jelentenek garanciát.

Az alap részletes leírását, befektetési politikáját, a költségeket a Tájékoztató és a Kezelési szabályzat tartalmazzák, melyek elérhetők a forgalmazási helyeken és a [www.access.hu](http://www.access.hu) internetes oldalon.

Budapest, 2011. október 10.