

# Reverse Max Származtatott Befektetési Alap B sorozat



**marketprog**  
Asset Management

## ÁLTALÁNOS INFORMÁCIÓK

Alapkezelő:	Marketpro Asset Management Zrt.
Letétkezelő:	Unicredit Bank Zrt.
Vezető forgalmazó:	Marketpro Asset Management Zrt.
Benchmark összetétele:	100% ZMAX Index
ISIN kód:	HU0000725338
Indulás:	2020.06.12
Devizanem:	HUF
A teljes alap nettó eszközértéke:	495 135 511 HUF
B sorozat nettó eszközértéke:	1 675 619 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,675619 HUF

## BEFEKTETÉSI POLITIKA:

A MARKETPROG Reverse MAX Származtatott Alap elsődleges célja, hogy elsősorban HUF denominált kamatderivatív termékekbe történő befektetéseken keresztül pozitív megtérülést érjen el a HUF hozamok általános emelkedése esetén. Az Alapkezelő az Alap vagyontát passzív szemléletben kezeli, az Alap által felvállalt kamatkockázati kitétséget a MAX Index negatív durációjához igazítja. Az Alapkezelő kiemelt figyelmet fordít arra, hogy az Alap a lehető leghoroszabban kövesse a MAX Index negatív durációját és volatilitását. Az Alap összetételének kialakítása során az Alapkezelő dinamikusan alakítja ki a különböző instrumentumok súlyát, a MAX Index követési hibájának minimalizálása érdekében. Az Alap kizárólag HUF denominált Állampapírokba, Jelzáloglevelekbe, bankbetétekbe, valamint HUF denominált kamatderivatív termékekbe fektet. Az Alap a jogszabályban meghatározott limitek és szorzószámok figyelembevételével tőkeáttételt alkalmaz, de a teljes nettó kockázati kitétsége nem haladhatja meg a nettó eszközérték kétszeresét. A tőkeáttétellel való kereskedés az adott ügyletbe fektetett összegnél is nagyobb mértékű veszteséggel járhat. Az Alap fő célja, hogy a HUF hozamok általános emelkedése esetén tőkenövekedést érjen el és hatékony fedezetet nyújtson kötvényportfólió tulajdonosoknak. Az Alapot kiemelten intézményi kötvénybefektetőknek ajánljuk, akik magas kockázattűrő hajlandósággal rendelkeznek és legalább 2 éves időtávra be kívánják fektetni az Alapba.

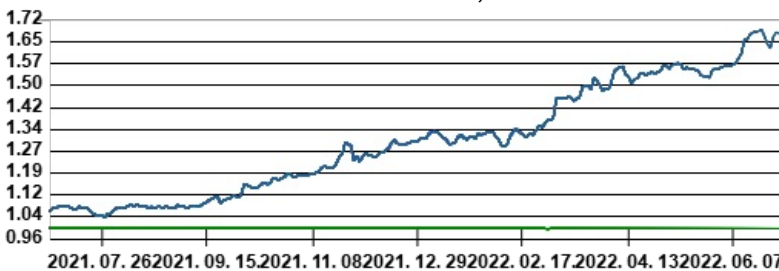
## FORGALMAZÓK

### AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	28,65 %	0,03 %
2021	46,14 %	0,00 %

## AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

### EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2021.07.01 - 2022.06.30



— Reverse Max Származtatott Befektetési Alap B 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: 15,46 %  
A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,05 %

## PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

### AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2022.06.30

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	32,35 %
Kincstárjegyek	19,13 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	44,38 %
Számlapénz	4,33 %
Kötelezettség	0,00 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	201,96 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	105,33 %

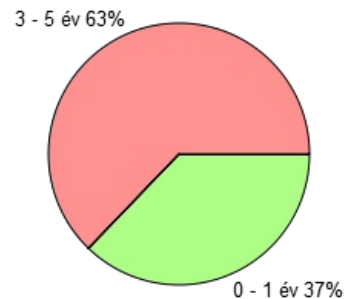
### A(z) 5 legnagyobb pozíció:

2027B (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)  
D230419 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

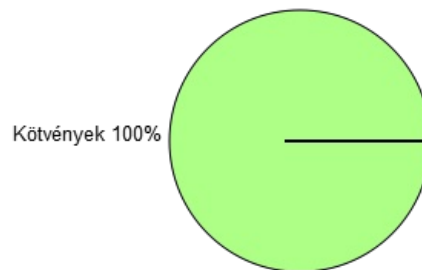
### 10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

2027B (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)  
D230419 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

### Lejárat szerinti megoszlás:



### A részvények szektoronkénti megoszlása:



## BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszak szórása alapján:

