

# Reverse Max Származtatott Befektetési Alap B sorozat



**marketpro**  
Asset Management

## ÁLTALÁNOS INFORMÁCIÓK

Alapkezelő:	Marketpro Asset Management Zrt.
Letétkezelő:	Erste Bank Hungary 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:	299 749 881 HUF
B sorozat nettó eszközértéke:	1 036 124 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,036124 HUF

## BEFEKTETÉSI POLITIKA:

A SKIPPER Abszolút Hozamú Származtatott Alap elsődleges célja a kockázatmentes hozamnál magasabb megtérülés elérése hosszú távon többlet kockázatok vállalásával, döntően államkötvény- és devizabefektetések és spekulatív származtatott ügyletek segítségével. Az Alapkezelő az Alap vagyonát abszolút hozamú szemléletben kezeli, megcélózva ezzel a kockázatmentes hozamot meghaladó megtérülést. Az Alapkezelő kiemelt figyelmet fordít a magas szintű és hatékony kockázatkezelésre, a volatilitás elfogadható szinten tartása érdekében. Az alap a jogszabályban meghatározott limitek és szorzószámok figyelembe vételével tőkeáttételes, hosszú (vételi) és fedezetlen rövid (eladási) pozíciókat is felvehet. Az Alap összetételének kialakítása során az Alapkezelő dinamikusan alakítja ki a különböző eszközcsoportok súlyát a piaci helyzet és a követett stratégia függvényében. Az Alapkezelő a fundamentális elemzések mellett kiemelt figyelmet fordít a piaci hangulat ingadozására, és a technikai elemzés eszközeit is használja a piacra lépés időzítésekor. Az Alap befektetéseinek fókuszja a fejlődő országok államkötvény- és devizapiacai és azok derivatív piacainak kibocsátói. Ugyanakkor az Alap a globális piacokon (kötvény, nyersanyag, részvény, stb.) is széles körben fektethet kedvezőnek ítélt befektetési lehetőségekbe. A referenciahozam a 1 hónapos EURIBOR Fixing éves számtani átlaga (Bloomberg). Az Alap nem rendelkezik előre meghatározott földrajzi vagy szektorális megkötéssel.

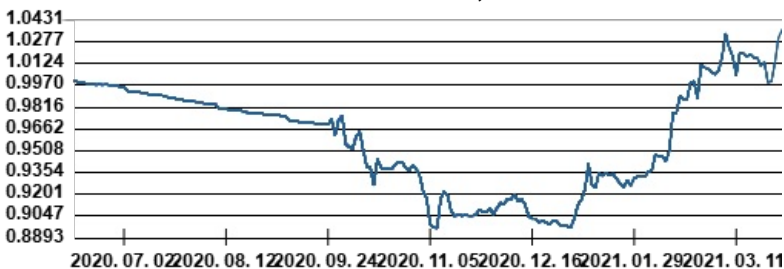
## FORGALMAZÓK

### AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	3,61 %	0,10 %
1 hónap	2,62 %	0,00 %
3 hónap	15,33 %	0,00 %
6 hónap	6,20 %	0,00 %

## AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

### EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2020.06.12 - 2021.03.31



— 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: 7,95 %  
A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,38 %

## PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

### AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2021.03.31

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	62,82 %
Számlapénz	30,75 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	6,85 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	333,61 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	100,57 %

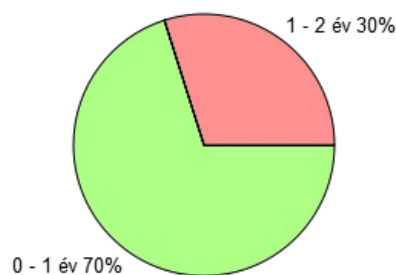
### A(z) 5 legnagyobb pozíció:

2021B (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)  
2022A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)  
2021C (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

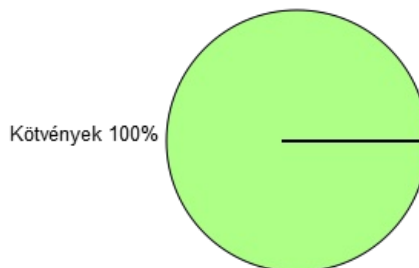
### 10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

2021B (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)  
2022A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)  
2021C (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

## Lejárat szerinti megoszlás:



## A részvények szektoronkénti megoszlása:



## 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