

# Reverse Max Származtatott Befektetési Alap

## A sorozat



**marketprog**  
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:	HU0000719315
Indulás:	2018.04.12
Devizanem:	HUF
A teljes alap nettó eszközértéke:	311 624 818 HUF
HUF sorozat nettó eszközértéke:	310 555 277 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,020680 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 referenziahozam a 1 hónapos EURIBOR Fixing éves számtani átlaga (Bloomberg). Az Alap nem rendelkezik előre meghatározott földrajzi vagy szektorális megkötéssel.

### FORGALMAZÓK

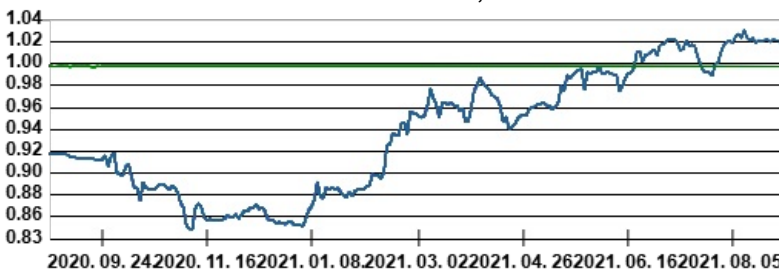
Marketpro Asset Management Zrt.

### AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

Időtáv	Befektetési jegy	Benchmark
indulástól	0,61 %	0,11 %
2020	-16,74 %	0,27 %
2019	1,05 %	0,05 %

### AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

#### EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2020.09.01 - 2021.08.31



— Reverse Max Származtatott Befektetési Alap A 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: 11,36 %

A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,01 %

### PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

#### AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2021.08.31

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	43,34 %
Számlapénz	45,96 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	11,07 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	320,90 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	100,24 %

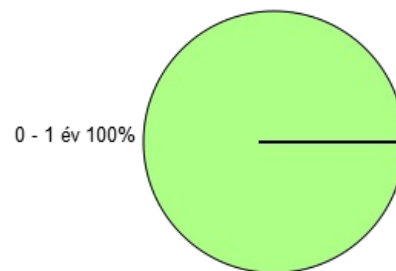
#### A(z) 5 legnagyobb pozíció:

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

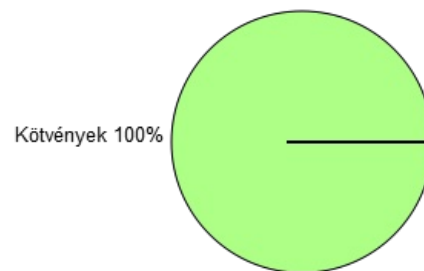
#### 10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

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

#### Lejárat szerinti megoszlás:



#### A részvények szektoronkénti megoszlása:



### BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:



Kockázati besorolás a heti hozamok elmúlt időszaki szórása alapján:

