

Reverse Max Származtatott Befektetési Alap

A 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: | HU0000719315 |
| Indulás: | 2018.04.12 |
| Devizanem: | HUF |
| A teljes alap nettó eszközértéke: | 575 563 895 HUF |
| HUF sorozat nettó eszközértéke: | 573 621 692 HUF |
| Egy jegyre jutó nettó eszközérték: | 1,885281 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 leghosszabbban 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. Az Alapkezelőnek az alap kezelése során nem célja a fenntarthatósági tényezők előmozdítása.

FORGALMAZÓK

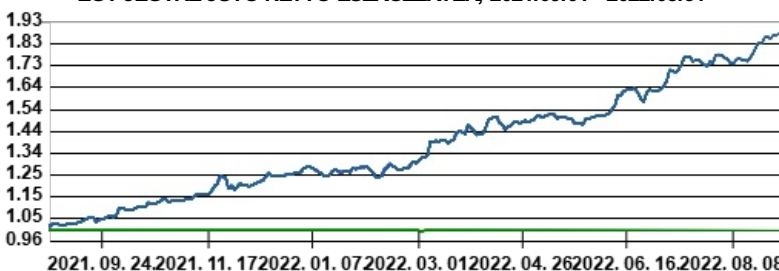
Marketpro Asset Management Zrt.

AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

| Időtáv | Befektetési jegy | Benchmark |
|------------|------------------|-----------|
| indulástól | 15,55 % | 0,08 % |
| 2021 | 48,65 % | 0,00 % |
| 2020 | -16,74 % | 0,27 % |
| 2019 | 1,05 % | 0,05 % |

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2021.09.01 - 2022.08.31



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: 16,58 %

A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,05 %

PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2022.08.31

| Eszköz típusa | Részarány |
|-----------------------------------|-----------|
| Államkötvények | 28,41 % |
| Kincstárjegyek | 16,45 % |
| Nyitott derivatív pozíciók értéke | 51,37 % |
| Számlapénz | 3,99 % |
| Összesen | 100,00 % |
| Származtatott ügyletek | 173,74 % |
| Nettó korrekciós tőkeáttétel | 103,96 % |

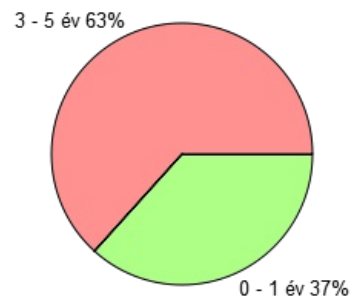
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

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

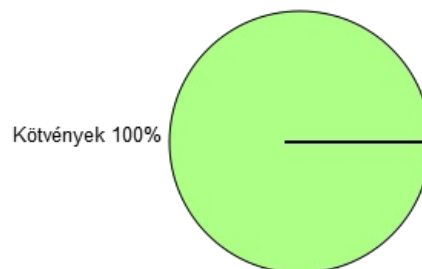
10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

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 időszakos szórása alapján:

