

# Reverse Max Származtatott Befektetési Alap

## B sorozat



marketprog  
Asset Management

### ÁLTALÁNOS INFORMÁCIÓK

Alapkezelő:	Marketprog Asset Management Zrt.
Letétkezelő:	Unicredit Bank Zrt.
Vezető forgalmazó:	Marketprog Asset Management Zrt.
Benchmark összetétele:	100% ZMAX Index
ISIN kód:	HU0000725338
Indulás:	2020.06.12
Devizanem:	HUF
A teljes alap nettó eszközértéke:	454 955 332 HUF
B sorozat nettó eszközértéke:	1 544 088 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,544088 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 vagyont 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 leghamarabban 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	25,96 %	0,03 %
2021	46,14 %	0,00 %

### AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

#### EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2021.05.01 - 2022.04.30



— 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: 14,87 %  
A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,05 %

### PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

#### AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2022.04.30

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	11,64 %
Kincstárjegyek	10,93 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	39,58 %
Számlapénz	37,84 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	219,55 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	100,55 %

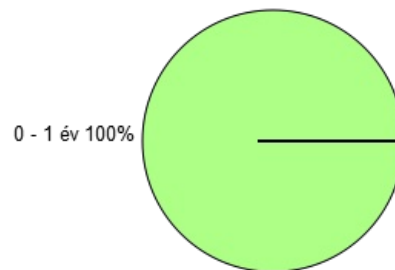
#### A(z) 5 legnagyobb pozíció:

2022A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)  
D220525 (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)

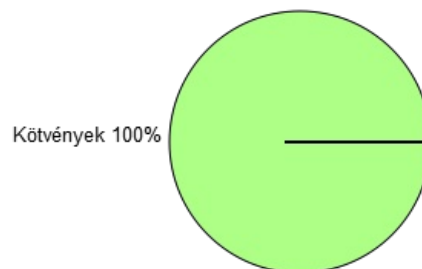
#### 10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

2022A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)  
D220525 (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 időszakos szórása alapján:

nagyon alacsony  alacsony  mérsékelt  közepes  jelentős  magas  nagyon magas