

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:	544 085 776 HUF
B sorozat nettó eszközértéke:	1 838 796 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,838796 HUF

BEFETETÉSI 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	33,04 %	0,02 %
2021	46,14 %	0,00 %

AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2021.08.01 - 2022.07.31



— 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: 16,02 %
A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,05 %

PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2022.07.31

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	29,54 %
Kincstárjegyek	17,24 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	48,86 %
Számlapénz	4,31 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	183,37 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	104,29 %

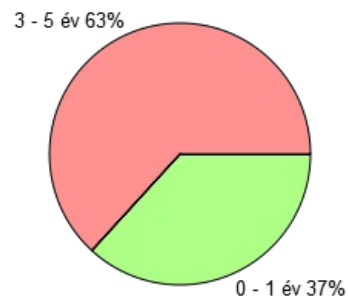
A(z) 5 legnagyobb pozíció:

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

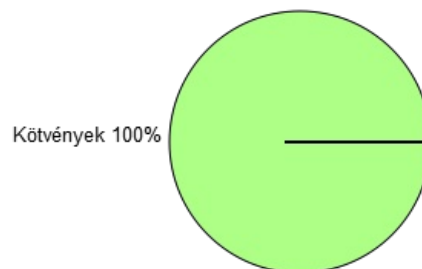
10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

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

Lejárat szerinti megoszlás:



A részvények szektoronkénti megoszlása:



BEFETETÉSI 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 időszak szórása alapján:

nagyon alacsony alacsony mérsékelt közepes jelentős magas nagyon magas