

# Reverse Max Származtatott Befektetési Alap

## B sorozat



marketpro  
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:  | 575 563 895 HUF                 |
| B sorozat nettó eszközértéke:      | 1 942 203 HUF                   |
| Egy jegyre jutó nettó eszközérték: | 1,942203 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 leghamarábban 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.

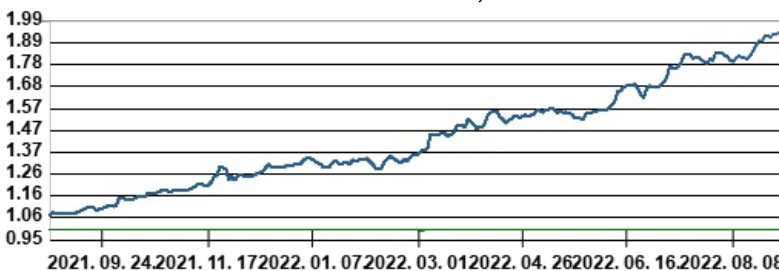
### FORGALMAZÓK

#### AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

| Időtáv     | Befektetési jegy | Benchmark |
|------------|------------------|-----------|
| indulástól | 34,88 %          | 0,02 %    |
| 2021       | 46,14 %          | 0,00 %    |

#### AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

##### EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2021.09.01 - 2022.08.31



— Reverse Max Származtatott Befektetési Alap B sorozat — Benchmark

A múltbéli 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: 16,56 %

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 %  |

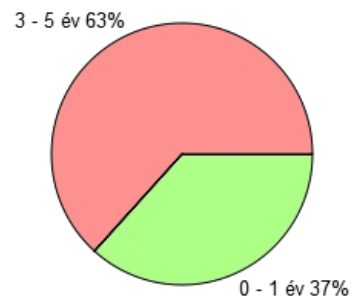
#### A(z) 5 legnagyobb pozíció:

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

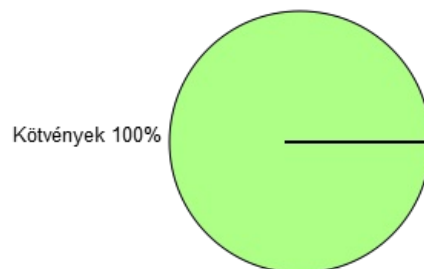
#### 10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

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

#### Lejárat szerinti megoszlás:



#### A részvények szektoronkénti megoszlása:



### BEFEKTETÉSI HORIZONT:

A javasolt minimális befektetési idő:

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