

# Reverse Max Származtatott Befektetési Alap B 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:                          | HU0000725338                    |
| Indulás:                           | 2020.06.12                      |
| Devizanem:                         | HUF                             |
| A teljes alap nettó eszközértéke:  | 291 640 865 HUF                 |
| B sorozat nettó eszközértéke:      | 1 009 641 HUF                   |
| Egy jegyre jutó nettó eszközérték: | 1,009641 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, megcélözva 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 referenciahozam a 1 hónapos EURIBOR Fixing éves számtani átlaga (Bloomberg). Az Alap nem rendelkezik előre meghatározott földrajzi vagy szektorális megkötéssel.

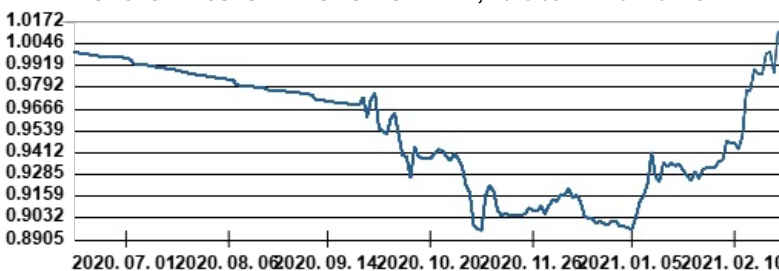
## FORGALMAZÓK

### AZ ALAP ÁLTAL ELÉRT NETTÓ HOZAM:

| Időtáv     | Befektetési jegy | Benchmark |
|------------|------------------|-----------|
| indulástól | 0,96 %           | 0,10 %    |
| 1 hónap    | 8,39 %           | 0,00 %    |
| 3 hónap    | 10,94 %          | 0,00 %    |
| 6 hónap    | 3,41 %           | -0,01 %   |

## AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

### EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2020.06.12 - 2021.02.28



— 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 listával 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: 7,43 %  
A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,38 %

## PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

### AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2021.02.28

| Eszköz típusa                     | Részarány |
|-----------------------------------|-----------|
| Államkötvények                    | 64,29 %   |
| Számlapénz                        | 30,39 %   |
| Nyitott derivatív pozíciók értéke | 5,29 %    |
| Összesen                          | 100,00 %  |
| Származtatott ügyletek            | 341,58 %  |
| Nettó korrekciós tőkeáttétel      | 101,18 %  |

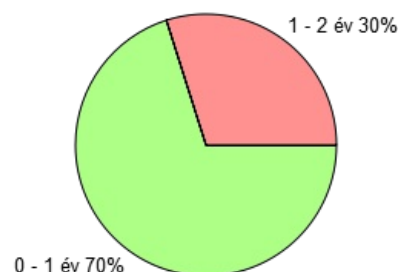
### A(z) 5 legnagyobb pozíció:

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

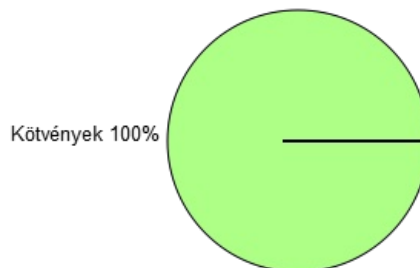
### 10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

2021B (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)  
2022A (Államadósság Kezelő Központ Zrt.)  
2021C (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 időszaki szórása alapján:

nagyon alacsony  alacsony  mérsékelt  közepes  jelentős  magas  nagyon magas