

# 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:	308 462 084 HUF
B sorozat nettó eszközértéke:	1 061 741 HUF
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,061741 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, megcélózva 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 lehetőségekre. 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	5,88 %	0,09 %

#### AZ ALAP TELJESÍTMÉNYE AZ ELMÚLT 12 HÓNAPBAN

##### EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK, 2020.07.01 - 2021.06.30



— 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: 10,69 %

A benchmark heti hozamokból számolt évesített szórása: 0,03 %

### PIACI ÖSSZEFOGLALÓ:

#### AZ ALAP ESZKÖZÖSSZETÉTELE 2021.06.30

Eszköz típusa	Részarány
Államkötvények	43,71 %
Számlapénz	46,66 %
Nyitott derivatív pozíciók értéke	9,92 %
Összesen	100,00 %
Származtatott ügyletek	324,19 %
Nettó korrekciós tőkeáttétel	100,03 %

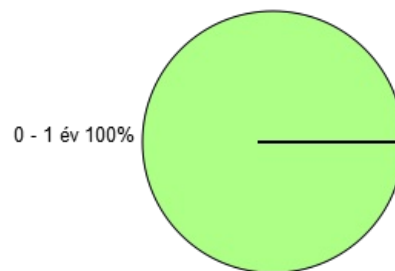
#### A(z) 5 legnagyobb pozíció:

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

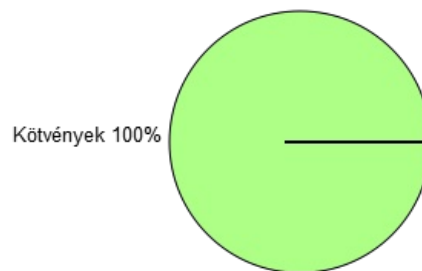
#### 10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök

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

nagyon alacsony  alacsony  mérsékelt  közepes  jelentős  magas  nagyon magas