

# **REVERSE MAX SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP**

**FÉLÉVES JELENTÉS**

**2021**

**KÉSZÜLT: 2021. AUGUSZTUS 25.**

**MARKETPROG ASSET MANAGEMENT BEFEKTETÉSI  
ALAPKEZELŐ ZRT.**

A féléves jelentés a kollektív befektetési formákról és kezelőikről szóló 2014. évi XVI. törvény (továbbiakban: Kbfv.) alapján készült, az Alap 2021. első félévi működésének bemutatása céljából.

Tárgyidőszak: 2021.01.01.- 2021.06.30.

### **ÁLTALÁNOS ADATOK**

Az alap megnevezése:	Reverse Max Származtatott Befektetési Alap
A Részalap típusa:	Magyarországon, nyilvános forgalomba hozatal útján létrehozott nyíltvégű, értékpapír befektetési alap
A Részalap futamideje:	A nyilvántartásba vételtől határozatlan ideig tart.
Harmonizáció szerint:	ABAK-irányelv alapján harmonizált alap
Alapkezelő:	MARKETPROG Asset Management Befektetési Alapkezelő Zrt. (1124 Budapest, Csörsz utca 45.)
Letétkezelő:	Erste Bank Zrt. (1138 Budapest, Népfürdő utca 24-26.)
Könyvvizsgáló:	PricewaterhouseCoopers Könyvvizsgáló Kft. (1055 Budapest, Bajcsy-Zsilinszky út 78.), a könyvvizsgálatért személyében felelős könyvvizsgáló: Barsi Éva/002945
Vezető forgalmazó:	MARKETPROG Asset Management Befektetési Alapkezelő Zrt. (1124 Budapest, Csörsz utca 45.)
Forgalmazó:	MARKETPROG Asset Management Befektetési Alapkezelő Zrt. (1124 Budapest, Csörsz utca 45.)

## I. VAGYONKIMUTATÁS

A befektetési alap eszközeinek és forrásainak összetétele a tárgyidőszak elején és végén, valamint az adott eszköz összes eszközön belüli aránya:

Megnevezés	2020.12.31		2021.06.30	
	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)
Banki egyenlegek	90 355 196	34,91	143 941 426	46,66
Repo				
Átruházható értékpapírok	188 509 770	72,83	134 833 300	43,71
Származékos ügyletek	-18 471 013	-7,14	30 586 380	9,92
Egyéb eszközök		0,00		0,00
<b>Összes eszköz</b>	<b>260 393 953</b>	<b>100,61</b>	<b>309 361 106</b>	<b>100,29</b>
Kötelezettségek	-1 570 653	-0,61	-899 022	-0,29
<b>Nettó eszközérték</b>	<b>258 823 300</b>	<b>100,00</b>	<b>308 462 084</b>	<b>100,00</b>

A táblázat az időszak utolsó forgalmazási napjára érvényes nettó eszközérték alapján készült.

## II. FORGALOMBAN LÉVŐ BEFEKTETÉSI JEGYEK SZÁMA

Befektetési jegy				2020.12.31	2021.06.30
alap	sorozat	deviza	ISIN		
Reverse Max Származtatott Befektetési Alap	A	HUF	HU0000719315	304 263 233	304 263 233
Reverse Max Származtatott Befektetési Alap	B	HUF	HU0000725338	1 000 000	1 000 000

A táblázat az időszak utolsó forgalmazási napjára érvényes nettó eszközérték alapján készült.

## III. AZ EGY BEFEKTETÉSI JEGYRE ESŐ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK

Befektetési jegy				2020.12.31	2021.06.30
alap	sorozat	deviza	ISIN		
Reverse Max Származtatott Befektetési Alap	A	HUF	HU0000719315	0.847703	1.010311
Reverse Max Származtatott Befektetési Alap	B	HUF	HU0000725338	0.898402	1.061741

A táblázat az időszak utolsó forgalmazási napjára érvényes nettó eszközérték alapján készült.

#### IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

Megnevezés	2020.12.31		2021.06.30	
	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)
Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok összesen				
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok összesen				
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok összesen				
Egyéb átruházható értékpapírok				
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Államháztartás	188 509 770	100,00	134 833 300	100,00
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen	188 509 770	100,00	134 833 300	100,00
Értékpapírok összesen	188 509 770	100,00	134 833 300	100,00

A táblázat az időszak utolsó forgalmazási napjára érvényes nettó eszközérték alapján készült.