

# **MARKETPROG ESERNYŐALAP BOND DERIVATÍV KÖTVÉNY SZÁRMAZTATOTT RÉSZALAP**

**FÉLÉVES JELENTÉS**  
**2021**

**KÉSZÜLT: 2021. AUGUSZTUS 25.**

**MARKETPROG ASSET MANAGEMENT BEFKETETÉSI  
ALAPKEZELŐ ZRT.**

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

Tárgyidőszak: 2021.01.01.- 2021.06.30.

## **ÁLTALÁNOS ADATOK**

A Részalap megnevezése:	MARKETPROG Esernyőalap Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap
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: Lippényi Krisztina/006097
Vezető forgalmazó:	MARKETPROG Asset Management Befektetési Alapkezelő Zrt. (1124 Budapest, Csörsz utca 45.)
Forgalmazók:	Concorde Értékpapír Zrt.(1123 Budapest, Alkotás utca 50), SPB Befektetési Zrt. (1051 Budapest, Vörösmarty ér 7-8. 3.em.) Erste Befektetési Zrt. (1138 Budapest, Népfürdő utca 24-26.) Magyar Takarékszövetkezeti Bank Zrt. (1122 Bp., Pethényi köz 10.)

## 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	283 276 775	2,84	101 043 517	1,01
Repo	-3 488 092 440	-34,96	2 911 726 662	29,21
Átruházható értékpapírok	12 075 851 923	121,04	7 840 355 925	78,64
Származékos ügyletek	32 591 228	0,33	73 283 379	0,74
Egyéb eszközök	1 140 796 062	11,43	884 927 482	8,88
<b>Összes eszköz</b>	<b>10 044 423 548</b>	<b>100,68</b>	<b>11 811 336 965</b>	<b>118,47</b>
Kötelezettségek	-67 893 109	-0,68	-1 841 619 838	-18,47
<b>Nettó eszközérték</b>	<b>9 976 530 439</b>	<b>100,00</b>	<b>9 969 717 128</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		
MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap	A	HUF	HU0000714555	714 375 779	3 612 222 514
MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap	I	HUF	HU0000714688	488 543 681	522 829 544
MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap	B	EUR	HU0000714548	78 761 707	55 704 546
MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap	C	HUF	HU0000719356	6 805 432 095	3 469 693 271

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		
MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap	A	HUF	HU0000714555	1.391955	1.374776
MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap	I	HUF	HU0000714688	1.460799	1.449946
MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap	B	EUR	HU0000714548	0.01196	0.011602
MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap	C	HUF	HU0000719356	1.164444	1.158089

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				
Belföldi pénzügyi alapok befektetési jegyei	1 628 904 910	13,49	1 129 235 922	14,40
Belföldi nem pénzügyi alapok befektetési jegyei	380 235 643	3,15	419 024 404	5,34
Egyéb átruházható értékpapírok	2 009 140 553	16,64	1 558 259 316	19,87
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Államháztartás	7 287 378 000	60,35	3 630 978 000	46,31
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Államháztartás	1 674 427 307	13,87	1 588 252 257	20,26
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Monetáris pénzügyi intézmények	388 393 528	3,22		
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Nem pénzügyi vállalatok			707 471 021	9,02
Hitelviszonyt megtestesítő - Egyéb külföld	716 512 535	5,93	355 395 331	4,53
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen	10 066 711 370	83,36	6 282 096 609	80,13
Értékpapírok összesen	12 075 851 923	100,00	7 840 355 925	100,00

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