

MARKETPROG ESERNYŐALAP BOND DERIVATÍV KÖTVÉNY SZÁRMAZTATOTT RÉSZALAP

FÉLÉVES JELENTÉS
2024

KÉSZÜLT: 2024. AUGUSZTUS 26.

**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 2024. első félévi működésének bemutatása céljából.

Tárgydőszak: 2024.01.01.- 2024.06.28.

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: | Unicredit Bank Hungary Zrt.(1054 Budapest, Szabadság tér 5-6) |
| 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.) MBH Befektetési Bank Zrt. (1117 Bp., Magyar Tudósok körútja 9 G.) Raiffeisen Bank Hungary Zrt. (1133 Budapest, Váci út 116-118) |

I. VAGYONKIMUTATÁS

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

| Megnevezés | 2023.12.29. | | 2024.06.28. | |
|--------------------------|-----------------------|------------------------|-----------------------|------------------------|
| | Összeg / Érték (HUF) | A NEÉ százalékában (%) | Összeg / Érték (HUF) | A NEÉ százalékában (%) |
| Banki egyenlegek | 13 123 661 | 0,09 | 313 590 | 0,00 |
| Repo | -500 001 913 | -3,27 | -44 002 892 | -0,32 |
| Átruházható értékpapírok | 15 265 148 463 | 99,80 | 14 401 207 732 | 104,04 |
| Származékos ügyletek | 758 593 641 | 4,96 | -495 686 811 | -3,58 |
| Egyéb eszközök | 32 469 755 | 0,21 | 14 736 264 | 0,11 |
| Összes eszköz | 15 569 333 607 | 101,79 | 13 876 567 883 | 100,25 |
| Kötelezettségek | -273 737 361 | -1,79 | -34 233 068 | -0,25 |
| Nettó eszközérték | 15 295 580 278 | 100,00 | 13 842 341 333 | 100,00 |

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

II. FORGALOMBAN LÉVŐ BEFEKTETÉSI JEGYEK SZÁMA

| Befektetési jegy | | | | 2023.12.29. | 2024.06.28. |
|--|---------|--------|--------------|---------------|---------------|
| alap | sorozat | deviza | ISIN | | |
| MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap | A | HUF | HU0000714555 | 4 361 998 913 | 4 189 840 583 |
| MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap | I | HUF | HU0000714688 | 823 656 891 | 796 094 898 |
| MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap | B | EUR | HU0000714548 | 406 660 558 | 246 681 103 |
| MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap | C | HUF | HU0000719356 | 510 821 634 | 501 362 633 |
| MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap | D | HUF | HU0000730288 | 900 000 000 | 900 000 000 |

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

III. AZ EGY BEFEKTETÉSI JEGYRE ESŐ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK

| Befektetési jegy | | | | 2023.12.29. | 2024.06.28. |
|--|---------|--------|--------------|-------------|-------------|
| alap | sorozat | deviza | ISIN | | |
| MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap | A | HUF | HU0000714555 | 2.043962 | 2.024223 |
| MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap | I | HUF | HU0000714688 | 2.198412 | 2.188049 |
| MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap | B | EUR | HU0000714548 | 0.01506 | 0.014546 |
| MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap | C | HUF | HU0000719356 | 1.841824 | 1.836791 |
| MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap | D | HUF | HU0000730288 | 1.426641 | 1.422755 |
| MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap | U | USD | HU0000719364 | | 0.00965 |

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

IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

| Megnevezés | 2023.12.29. | | 2024.06.28. | |
|--|----------------------|-----------------|----------------------|-----------------|
| | 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 | 593 945 051 | 3,89 | 648 532 234 | 4,50 |
| Belföldi nem pénzügyi alapok befektetési jegyei | 641 539 094 | 4,20 | 656 971 693 | 4,56 |
| Egyéb átruházható értékpapírok | 1 235 484 145 | 8,09 | 1 305 503 927 | 9,07 |
| Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Államháztartás | 7 254 813 150 | 47,53 | 6 725 298 000 | 46,70 |
| Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Monetáris pénzügyi intézmények | 6 774 851 168 | 44,38 | 6 370 405 805 | 44,24 |
| Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen | 14 029 664 318 | 91,91 | 13 095 703 805 | 90,93 |
| Értékpapírok összesen | 15 265 148 463 | 100,00 | 14 401 207 732 | 100,00 |

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