

# ALLEGRO ABSZOLÚT HOZAMÚ 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: Kbfvt.) alapján készült, az Alap 2024. első félévi működésének bemutatása céljából.

Tárgyidőszak: 2024.01.01.- 2024.06.30.

### **ÁLTALÁNOS ADATOK**

Az Részalap megnevezése:	MARKETPROG Esernyőalap Allegro Abszolút Hozamú Származtatott Részalap (régi név : Head Abszolút Hozamú 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: 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.) Raffaelsen Bank Zrt. (1133 Budapest, Váci út 116-118.) Erste Befektetési Zrt. (1138 Budapest, Népfürdő u.24-26.

## 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 (EUR)	A NEÉ százalékában (%)	Összeg / Érték (EUR)	A NEÉ százalékában (%)
Banki egyenlegek	55 493	105,56	411 156	54,38
Repo				
Átruházható értékpapírok			73 135	9,67
Származékos ügyletek			-195	-0,03
Egyéb eszközök		0,00	376 844	49,84
Összes eszköz	55 493	105,56	860 941	113,86
Kötelezettségek	-2 925	-5,56	-104 804	-13,86
Nettó eszközérték	52 570	100,00	756 122	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		
Allegro Abszolút Hozamú Származtatott Részalap	A	EUR	HU0000720719	8 053 000	8 053 000
Allegro Abszolút Hozamú Származtatott Részalap	B	USD	HU0000731955		27 579 811
Allegro Abszolút Hozamú Származtatott Részalap	C	EUR	HU0000734819		45 136 999
Allegro Abszolút Hozamú Származtatott Részalap	D	HUF	HU0000734827		10 000 000

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		
Allegro Abszolút Hozamú Származtatott Részalap	A	EUR	HU0000720719	0.006528	0.005959
Allegro Abszolút Hozamú Származtatott Részalap	B	USD	HU0000731955		0.009712
Allegro Abszolút Hozamú Származtatott Részalap	C	EUR	HU0000734819		0.009598
Allegro Abszolút Hozamú Származtatott Részalap	D	HUF	HU0000734827		0.968453

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 (EUR)	Százalékban (%)	Összeg / Érték (EUR)	Százalékban (%)
Részvény - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok			22 979	31,42
Részvény - GMU			16 404	22,43
Részvény - Egyéb külföld			33 752	46,15
Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok összesen			73 135	100,00
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok összesen				
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok összesen				
Egyéb átruházható értékpapírok				
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen				
Értékpapírok összesen		100,00	73 135	100,00

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