

MARKETPROG ESERNYŐALAP BOND DERIVATÍV KÖTVÉNY SZÁRMAZTATOTT RÉSZALAP

FÉLÉVES JELENTÉS
2020

KÉSZÜLT: 2020. AUGUSZTUS 24.

**MARKETPROG ASSET MANAGEMENT BEFKETETÉSI
ALAPKEZELŐ ZRT.**

A féléves jelentés a kollektív befektetési formákról és kezelőikről szóló 2014. évi XVI. törvény (továbbiakban: Kbtv.) alapján készült, az Alap 2020. első félévi működésének bemutatása céljából.

Tárgydőszak: 2020.01.01.- 2020.06.30.

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: Barsi Éva/002945
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	2019.12.30		2020.06.30	
	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)
Banki egyenlegek	1 708 524 994	17,36	214 906 856	2,57
Repo			-3 886 715 490	-46,56
Átruházható értékpapírok	8 159 716 305	82,93	11 254 212 907	134,82
Származékos ügyletek	14 376 132	0,15	-29 696 403	-0,36
Egyéb eszközök	483 183 998	4,91	849 999 998	10,18
Összes eszköz	10 365 801 429	105,35	8 402 707 868	100,66
Kötelezettségek	-526 639 159	-5,35	-55 279 129	-0,66
Nettó eszközérték	9 839 162 271	100,00	8 347 428 738	100,00

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

II. FORGALOMBAN LÉVŐ BEFEKTETÉSI JEGYEK SZÁMA

Befektetési jegy				2019.12.30	2020.06.30
alap	sorozat	deviza	ISIN		
MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Számaztatott Részalap	A	HUF	HU0000714555	885 275 556	715 724 116
MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Számaztatott Részalap	I	HUF	HU0000714688	664 631 899	488 543 681
MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Számaztatott Részalap	B	EUR	HU0000714548	104 819 301	73 198 927
MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Számaztatott Részalap	C	HUF	HU0000719356	6 579 402 583	5 615 053 577

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

III. AZ EGY BEFEKTETÉSI JEGYRE ESŐ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK

Befektetési jegy				2019.12.30	2020.06.30
alap	sorozat	deviza	ISIN		
MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap	A	HUF	HU0000714555	1.34708	1.365505
MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap	I	HUF	HU0000714688	1.401577	1.426909
MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap	B	EUR	HU0000714548	0.011651	0.011726
MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap	C	HUF	HU0000719356	1.111228	1.133908

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

IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

Megnevezés	2019.12.30		2020.06.30	
	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	7 935 371 805	97,25	8 753 882 376	77,78
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Államháztartás			387 005 057	3,44
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Monetáris pénzügyi intézmények			378 632 769	3,36
Hitelviszonyt megtestesítő - Egyéb külföld			1 076 660 302	9,57
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen	7 935 371 805	97,25	10 596 180 504	94,15
Értékpapírok összesen	8 159 716 305	100,00	11 254 212 907	100,00

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