

DOUBLE ABSZOLÚT HOZAMÚ SZÁRMAZTATOTT ALAP

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: Kbfv.) alapján készült, az Alap 2021. első félévi működésének bemutatása céljából.

Tárgyidőszak: 2021.01.01.- 2021.06.30.

ÁLTALÁNOS ADATOK

Az alap megnevezése:	Double Abszolút Hozamú Származtatott 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: Mészáros Balázs/005589
Vezető forgalmazó:	MARKETPROG Asset Management Befektetési Alapkezelő Zrt. (1124 Budapest, Csörsz utca 45.)
Forgalmazók:	Erste Befektetési Zrt. (1138 Budapest, Népfürdő utca 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	2020.12.31		2021.06.30	
	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)
Banki egyenlegek	91 468 654	9,42	404 648 161	34,50
Repo				
Átruházható értékpapírok	854 373 073	87,95	787 921 434	67,18
Származékos ügyletek		0,00	-114 851	-0,01
Egyéb eszközök	30 698 052	3,16	9 138 015	0,78
Összes eszköz	976 539 779	100,52	1 201 592 759	102,45
Kötelezettségek	-5 077 521	-0,52	-28 785 786	-2,45
Nettó eszközérték	971 462 258	100,00	1 172 806 973	100,00

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		
Double Abszolút Hozamú Szármasztatott Alap	A	HUF	HU0000718242	1 102 696 791	1 283 190 830

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		
Double Abszolút Hozamú Szármasztatott Alap	A	HUF	HU0000718242	0.880988	0.913977

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 (%)
Részvény - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok	43 800 000	5,13		
Részvény - GMU			12 282 700	1,56
Részvény - Egyéb külföld	262 615 048	30,74	128 418 078	16,30
Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok összesen	306 415 048	35,86	140 700 778	17,86
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok összesen				
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok összesen				
Egyéb átruházható értékpapírok				
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Államháztartás	547 958 025	64,14	647 220 656	82,14
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen	547 958 025	64,14	647 220 656	82,14
Értékpapírok összesen	854 373 073	100,00	787 921 434	100,00

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