

Féléves Jelentés 2015.06.30.

MARKETPROG Esernyőalap Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap

MNB Lajstromszám: 1111-607-2

MNB Engedélyszám: H-KE-III-397/2015

ISIN kód: HU0000714555

Féléves jelentés a kollektív befektetési formákról és kezelőikről szóló 2014. évi XVI. törvény (továbbiakban: Kbftv.) alapján készült.

Tárgydőszak: 2015.06.05. - 2015.06.30.

ÁLTALÁNOS ADATOK

| | |
|-------------------------|--|
| A Részalap megnevezése: | Marketprog Esernyőalap Alternatív Alapokba Fektető 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 könyvvizsgálattal 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.) |

I. VAGYONKIMUTATÁS

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

| Megnevezés | 2014.12.30. | | 2015.06.30. | |
|--------------------------|----------------------|------------------------|----------------------|------------------------|
| | Összeg / Érték (HUF) | A NEÉ százalékában (%) | Összeg / Érték (HUF) | A NEÉ százalékában (%) |
| Banki egyenlegek | | | 516 532 | 0,47 |
| Repo | | | | |
| Átruházható értékpapírok | | | 194 138 532 | 174,79 |
| Származékos ügyletek | | | | |
| Egyéb eszközök | | | | 0,00 |
| Összes eszköz | | | 194 655 064 | 175,26 |
| Kötelezettségek | | | -83 587 455 | -75,26 |
| Nettó eszközérték | | 100,00 | 111 067 645 | 100,00 |

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

II. FORGALOMBAN LÉVŐ BEFEKTETÉSI JEGYEK SZÁMA

| Befektetési jegy | | | | 2014.12.30. | 2015.06.30. |
|--|---------|--------|--------------|-------------|-------------|
| alap | sorozat | deviza | ISIN | | |
| MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap | A | HUF | HU0000714555 | | 11 000 000 |
| MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap | I | HUF | HU0000714688 | | 100 167 279 |
| MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap | B | EUR | HU0000714548 | | |

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

III. AZ EGY BEFEKTETÉSI JEGYRE ESŐ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK

| Befektetési jegy | | | | 2014.12.30. | 2015.06.30. |
|--|---------|--------|--------------|-------------|-------------|
| alap | sorozat | deviza | ISIN | | |
| MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap | A | HUF | HU0000714555 | | 0.998464 |
| MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap | I | HUF | HU0000714688 | | 0.999174 |
| MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap | B | EUR | HU0000714548 | | 0.01 |

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

IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

| Megnevezés | 2014.12.30. | | 2015.06.30. | |
|--|-------------------------|--------------------|-------------------------|--------------------|
| | 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 | | | 194 138 532 | 100,00 |
| Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen | | | 194 138 532 | 100,00 |
| Értékpapírok összesen | | 100,00 | 194 138 532 | 100,00 |

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

V. A BEFEKTETÉSI ALAP ESZKÖZEINEK ALAKULÁSA

| | Megnevezés | 2015.06.30 |
|-----|---|-------------------|
| a.) | befektetésből származó jövedelem | 83 633 |
| b.) | egyéb bevétel | 0 |
| c.) | kezelési költségek | 106 617 |
| d.) | letétkezelő díjai | 8 628 |
| e.) | egyéb díjak és adók | 225 955 |
| f.) | nettó jövedelem | -327 381 |
| g.) | felosztott és újra befektetett jövedelem | 0 |
| h.) | a tőkeszámla változásai | 125 167 279 |
| i.) | a befektetések értéknövekedése (+), illetve értékcsökkenése (-) | 69 814 |
| j.) | minden egyéb olyan változás, amely hatást gyakorol a befektetési alap eszközeire és kötelezettségeire | nincs ilyen tétel |

VI. A NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK ÉS AZ EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK VÁLTOZÁSA AZ ELMÚLT HÁROM ÜZLETI ÉVBEN

| Alap neve Fund | Sorozat Serie | Deviza Curre ncy | ISIN | Nettó eszközérték Net Asset Value | 1 jegyre jutó eszközérték Unit price | Értéknap Value date |
|--|------------------|------------------------|--------------|--------------------------------------|--|------------------------|
| MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap | A | HUF | HU0000714555 | 10 983 104 | 0,998464 | 2015.06.30. |
| MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap | I | HUF | HU0000714688 | 100 084 541 | 0,999174 | 2015.06.30. |
| MARKETPROG Bond Derivatív Kötvény Származtatott Részalap | B | EUR | HU0000714548 | | 0,010000 | 2015.06.30. |

VII. SZÁRMAZTATOTT ÜGYLETEK

A Részalap 2015. I. félévében származtatott ügyletet nem kötött.

VIII. A BEFEKTETÉSI ALAPKEZELŐ MŰKÖDÉSÉBEN BEKÖVETKEZETT VÁLTOZÁSOK, VALAMINT A BEFEKTETÉSI POLITIKA ALAKULÁSÁRA HATÓ FONTOSABB TÉNYEZŐK BEMUTATÁSA

Az Alapkezelő 2015. január 30-án kezdte meg tevékenységét. A tárgyidőszakra vonatkozólag az Alapkezelő Igazgatóságában, illetve Felügyelő Bizottságában nem történt változás.

A Felügyelet 2015. április 08-án hagyta jóvá a befektetési jegyek nyilvános forgalomba hozatalához készített kezelési szabályzatot, tájékoztatót, kiemelt befektetői információkat és hirdetményt. Ezt követően 2015.06.03-án megtörtént az Alap nyilvántartásba vétele.

Az Alap befektetési politikáját részletesen a Kezelési Szabályzatának III. Fejezete tartalmazza, abban változás a tárgyidőszakban nem következett be.

IX. JAVADALMAZÁSRA VONATKOZÓ INFORMÁCIÓK

Mivel az Alapkezelő a Kbtv. 2. § (2) bekezdés szerinti ABAK-nak minősül, ezért jelen pont szerinti tájékoztatási kötelezettség rá nem vonatkozik.

X. LIKVIDITÁSKEZELÉSRE ÉS KOCKÁZATKEZELÉSRE VONATKOZÓ INFORMÁCIÓK

Mivel az Alapkezelő a Kbfv. 2. § (2) bekezdés szerinti ABAK-nak minősül, ezért jelen pont szerinti tájékoztatási kötelezettség rá nem vonatkozik.

XI. TŐKEÁTTÉTELRE VONATKOZÓ INFORMÁCIÓK

| | Összeg | Deviza | % |
|--------------------------------------|-------------|--------|-----|
| Nettó eszközérték | 111 067 645 | HUF | 100 |
| Származékos ügyletek | 0 | HUF | 0 |
| Nettó pozíció / tőkeáttétel | 111 067 609 | HUF | 100 |
| Nettó korrekciós pozíció/tőkeáttétel | 111 067 609 | HUF | 100 |