

ALLEGRO ABSZOLÚT HOZAMÚ SZÁRMAZTATOTT RÉSZALAP

FÉLÉVES JELENTÉS
2026

KÉSZÜLT: 2026. 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.

Tárgyidőszak: 2026.01.01.- 2026.06.30.

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.

A Részalap indulásának dátuma: 2018. június 15.

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.)
Raffaisen 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	2025.12.31.		2026.06.30.	
	Összeg / Érték (EUR)	A NEÉ százalékában (%)	Összeg / Érték (EUR)	A NEÉ százalékában (%)
Banki egyenlegek	435 039	16,37	490 341	14,67
Repo				
Átruházható értékpapírok	2 187 200	82,32	2 850 695	85,26
Származékos ügyletek	49 349	1,86	76 650	2,29
Egyéb eszközök	214	0,01	8 911	0,27
Összes eszköz	2 671 802	100,56	3 426 596	102,48
Kötelezettségek	-14 811	-0,56	-82 956	-2,48
Nettó eszközérték	2 656 971	100,00	3 343 607	100,00

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

II. FORGALOMBAN LÉVŐ BEFEKTETÉSI JEGYEK SZÁMA

Befektetési jegy				2025.12.31.	2026.06.30.
alap	sorozat	deviza	ISIN		
Allegro Abszolút Hozamú Származtatott Részalap	A	EUR	HU0000720719		
Allegro Abszolút Hozamú Származtatott Részalap	B	USD	HU0000731955	38 126 694	36 971 935
Allegro Abszolút Hozamú Származtatott Részalap	C	EUR	HU0000734819	124 239 302	178 547 825
Allegro Abszolút Hozamú Származtatott Részalap	D	HUF	HU0000734827	365 528 515	354 991 470

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

III. AZ EGY BEFEKTETÉSI JEGYRE ESŐ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK

Befektetési jegy				2025.12.31.	2026.06.30.
alap	sorozat	deviza	ISIN		
Allegro Abszolút Hozamú Származtatott Részalap	A	EUR	HU0000720719	0.006047	0.006047
Allegro Abszolút Hozamú Származtatott Részalap	B	USD	HU0000731955	0.010681	0.010909
Allegro Abszolút Hozamú Származtatott Részalap	C	EUR	HU0000734819	0.010283	0.010411
Allegro Abszolút Hozamú Származtatott Részalap	D	HUF	HU0000734827	1.088519	1.130952

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

IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

Megnevezés	2025.12.31.		2026.06.30.	
	Összeg / Érték (EUR)	Százalékban (%)	Összeg / Érték (EUR)	Százalékban (%)
Hitelviszonyt megtestesítő - Egyéb külföld	44 891	2,05	52 660	1,85
Részvény - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok	174 785	7,99	455 353	15,97
Részvény - GMU	374 537	17,12	520 591	18,26
Részvény - Egyéb külföld	709 124	32,42	1 103 232	38,70
Egyéb külföld nem pénzpiaci alapok befektetési jegyei			31 129	1,09
Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok összesen	1 303 337	59,59	2 162 965	75,88
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok összesen				
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok összesen				
Belföldi nem pénzpiaci alapok befektetési jegyei	477 405	21,83	409 233	14,36
Egyéb átruházható értékpapírok	477 405	21,83	409 233	14,36
Hitelviszonyt megtestesítő - Egyéb külföld	194 146	8,88	113 006	3,96
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Monetáris pénzügyi intézmények	103 751	4,74		
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok	108 561	4,96	165 492	5,81
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen	406 458	18,58	278 497	9,77
Értékpapírok összesen	2 187 200	100,00	2 850 695	100,00

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