

AURICA ABSZOLÚT HOZAMÚ SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP

FÉLÉVES JELENTÉS

2026

KÉSZÜLT: 2026. AUGUSZTUS 26.

**MARKETPROG ASSET MANAGEMENT BEFEKTETÉSI
ALAPKEZELŐ ZRT.**

A féléves jelentés a kollektív befektetési formákról és kezelőikről szóló 2014. évi XVI. törvény (továbbiakban: Kbfv.) alapján készült, az Alap 2024. első félévi működésének bemutatása céljából.

Tárgyidőszak: 2026.01.01.- 2026.06.30.

ÁLTALÁNOS ADATOK

Az Alap megnevezése:	AURICA Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap
Az Alap típusa:	Magyarországon, nyilvános forgalomba hozatal útján létrehozott nyíltvégű, értékpapír befektetési alap
Az Alap futamideje:	A nyilvántartásba vételtől határozatlan ideig tart.
Az Alap indulásának dátuma:	2024. október 01.
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.)

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 (HUF)	A NEÉ százalékában (%)	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)
Banki egyenlegek	10 598 669	3,10	49 334 818	13,12
Repo				
Átruházható értékpapírok	336 538 893	98,46	315 024 638	83,77
Származékos ügyletek	-3 246 030	-0,95	13 309 195	3,54
Egyéb eszközök		0,00		0,00
Összes eszköz	343 891 532	100,61	377 668 651	100,43
Kötelezettségek	-2 077 597	-0,61	-1 620 943	-0,43
Nettó eszközérték	341 808 119	100,00	376 048 246	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		
AURICA Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap	A	HUF	HU0000735287	92 881 260	97 643 837
AURICA Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap	B	EUR	HU0000735295	19 454 843	20 338 944
AURICA Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap	C	USD	HU0000735303	58 692 945	64 650 115

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		
AURICA Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap	A	HUF	HU0000735287	0.979863	1.050551
AURICA Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap	B	EUR	HU0000735295	0.009535	0.010226
AURICA Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap	C	USD	HU0000735303	0.009302	0.009909

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 (HUF)	Százalékban (%)	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)
Részvény - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok	4 820 313	1,43	37 782 317	11,99
Részvény - GMU	37 379 946	11,11	27 503 061	8,73
Részvény - Egyéb külföld	93 902 727	27,90	54 704 709	17,37
Egyéb külföld nem pénzpiaci alapok befektetési jegyei	63 396 247	18,84	103 127 175	32,74
Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok összesen	199 499 233	59,28	223 117 262	70,83
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok összesen				
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok összesen				
Egyéb átruházható értékpapírok				
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Államháztartás	102 735 600	30,53	59 572 650	18,91
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Államháztartás	16 772 639	4,98	15 705 830	4,99
Hitelviszonyt megtestesítő - Egyéb külföld	17 531 421	5,21	16 628 896	5,28
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen	137 039 660	40,72	91 907 376	29,17
Értékpapírok összesen	336 538 893	100,00	315 024 638	100,00

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