

**CONVEXITY 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:	Convexity 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:	2021. augusztus 16.
Harmonizáció szerint:	ABAK-irányelv alapján harmonizált alap
Alapkezelő:	MARKETPROG Asset Management Befektetési Alapkezelő Zrt. (1124 Budapest, Csörsz utca 45.)
Letétkezelő:	Raiffeisen Bank Zrt. (1133 Budapest, Váci út 116-118)
Könyvvizsgáló:	Könyv-Profit Könyvvizsgáló Kft.
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.) Concorde Értékpapír Zrt. Erste Befektetési Zrt. Raiffeisen Bank Zrt. <u>Kizárólag a befektetési jegyek visszaváltása kapcsán:</u> • HOLD Alapforgalmazó Zrt.

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	289 471 980	18,92	319 620 614	23,70
Repo				
Átruházható értékpapírok	1 243 521 855	81,26	1 068 360 569	79,21
Származékos ügyletek	14 161 833	0,93	11 964 167	0,89
Egyéb eszközök	416 136 307	27,19	829 082	0,06
Összes eszköz	1 963 291 975	128,30	1 400 774 432	103,86
Kötelezettségek	-432 437 363	-28,26	-51 999 433	-3,86
Nettó eszközérték	1 530 293 186	100,00	1 348 774 829	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		
Convexity Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap	A	HUF	HU0000727698	815 148 749	635 449 171
Convexity Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap	B	EUR	HU0000727706	809 526	1 011 710
Convexity Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap	C	USD	HU0000727714	171 211	77 784
Convexity Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap	D	HUF	HU0000727722	141 693 469	141 693 469

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		
Convexity Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap	A	HUF	HU0000727698	1.230528	1.262537
Convexity Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap	B	EUR	HU0000727706	0.926532	0.935577
Convexity Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap	C	USD	HU0000727714	1.030197	1.032119
Convexity Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap	D	HUF	HU0000727722	1.271991	1.308554

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 - GMU	15 296 737	1,23	18 850 349	1,76
Részvény - Egyéb külföld	30 268 197	2,43	34 205 679	3,20
Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok összesen	45 564 934	3,66	53 056 028	4,97
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok összesen				
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok összesen				
Egyéb átruházható értékpapírok				
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Monetáris pénzügyi intézmények	63 914 240	5,14	174 219 038	16,31
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Államháztartás	817 959 474	65,78	397 770 113	37,23
Hitelviszonyt megtestesítő - Egyéb külföld	316 083 207	25,42	443 315 390	41,49
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen	1 197 956 921	96,34	1 015 304 541	95,03
Értékpapírok összesen	1 243 521 855	100,00	1 068 360 569	100,00

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