

AURICA ABSZOLÚT HOZAMÚ SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP

FÉLÉVES JELENTÉS

2025

KÉSZÜLT: 2025. 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.

Tárgydőszak: 2025.01.01.- 2025.06.30.

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	2024.12.31.		2025.06.30.	
	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)
Banki egyenlegek	21 890 879	103,08	160 185 041	43,49
Repo				
Átruházható értékpapírok			227 797 152	61,84
Származékos ügyletek			-9 070 075	-2,46
Egyéb eszközök		0,00	7 855 000	2,13
Összes eszköz	21 890 879	103,08	386 767 118	105,00
Kötelezettségek	-653 913	-3,08	-18 414 106	-5,00
Nettó eszközérték	21 237 139	100,00	368 343 685	100,00

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

II. FORGALOMBAN LÉVŐ BEFEKTETÉSI JEGYEK SZÁMA

Befektetési jegy				2024.12.31.	2025.06.30.
alap	sorozat	deviza	ISIN		
AURICA Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap	A	HUF	HU0000735287	14 000 000	92 861 067
AURICA Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap	B	EUR	HU0000735295	1 000 000	21 965 776
AURICA Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap	C	USD	HU0000735303	1 000 000	67 267 530

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

III. AZ EGY BEFEKTETÉSI JEGYRE ESŐ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK

Befektetési jegy				2024.12.31.	2025.06.30.
alap	sorozat	deviza	ISIN		
AURICA Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap	A	HUF	HU0000735287	0.985407	0.923952
AURICA Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap	B	EUR	HU0000735295	0.00955	0.009067
AURICA Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap	C	USD	HU0000735303	0.008956	0.008866

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

IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

Megnevezés	2024.12.31.		2025.06.30.	
	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)
Részvény - Belföld - Nem pénzügyi vállalatok			18 672 220	8,20
Részvény - GMU			31 057 555	13,63
Részvény - Egyéb külföld			59 808 438	26,26
Egyéb külföld nem pénzpiaci alapok befektetési jegyei			53 535 149	23,50
Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok összesen			163 073 362	71,59
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok összesen				
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok összesen				
Egyéb átruházható értékpapírok				
Hitelviszonyt megtestesítő - Belföld - Monetáris pénzügyi intézmények			29 994 600	13,17
Hitelviszonyt megtestesítő - GMU - Államháztartás			17 104 139	7,51
Hitelviszonyt megtestesítő - Egyéb külföld			17 625 051	7,74
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen			64 723 790	28,41
Értékpapírok összesen		100,00	227 797 152	100,00

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