

CLAREO ABSZOLÚT HOZAMÚ SZÁRMAZTATOTT ALAP

FÉLÉVES JELENTÉS

2020

KÉSZÜLT: 2020. AUGUSZTUS 24.

**MARKETPROG ASSET MANAGEMENT BEFKETETÉSI
ALAPKEZELŐ ZRT.**

A féléves jelentés a kollektív befektetési formákról és kezelőikről szóló 2014. évi XVI. törvény (továbbiakban: Kbfv.) alapján készült, az Alap 2020. első félévi működésének bemutatása céljából.

Tárgyidőszak: 2020.01.01.- 2020.06.30.

ÁLTALÁNOS ADATOK

Az alap megnevezése:	Clareo Abszolút Hozamú Származtatott Alap
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:	Erste Bank Zrt. (1138 Budapest, Népfürdő utca 24-26)
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.)
Forgalmazók:	Erste Befektetési Zrt. (1138 Budapest, Népfürdő utca 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	2019.12.30		2020.06.30	
	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)
Banki egyenlegek	101 519 723	11,95	328 404 166	36,35
Repo				
Átruházható értékpapírok	748 607 487	88,15	579 192 289	64,10
Származékos ügyletek		0,00	-1 667 400	-0,18
Egyéb eszközök	2 222 371	0,26	36 364 138	4,02
Összes eszköz	852 349 581	100,36	942 293 193	104,29
Kötelezettségek	-3 091 862	-0,36	-38 745 548	-4,29
Nettó eszközérték	849 257 719	100,00	903 547 645	100,00

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

II. FORGALOMBAN LÉVŐ BEFEKTETÉSI JEGYEK SZÁMA

Befektetési jegy				2019.12.30	2020.06.30
alap	sorozat	deviza	ISIN		
Clareo Abszolút Hozamú Származtatott Alap	A	HUF	HU0000718242	982 350 794	1 045 249 323

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

III. AZ EGY BEFEKTETÉSI JEGYRE ESŐ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK

Befektetési jegy				2019.12.30	2020.06.30
alap	sorozat	deviza	ISIN		
Clareo Abszolút Hozamú Származtatott Alap	A	HUF	HU0000718242	0.864516	0.864433

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

IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

Megnevezés	2019.12.30		2020.06.30	
	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	748 607 487	100,00	579 192 289	100,00
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen	748 607 487	100,00	579 192 289	100,00
Értékpapírok összesen	748 607 487	100,00	579 192 289	100,00

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