

HIMALÁJA ABSZOLÚT HOZAMÚ SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP

FÉLÉVES JELENTÉS

2019

KÉSZÜLT: 2019. AUGUSZTUS 28.

**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 2019. első félévi működésének bemutatása céljából.

Tárgyidőszak: 2019.01.01.- 2019.06.30.

ÁLTALÁNOS ADATOK

Az alap megnevezése:	Himalája Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési 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	2018.12.30.		2019.06.28.	
	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)
Banki egyenlegek			249 619 139	100,07
Repo				
Átruházható értékpapírok				
Származékos ügyletek				
Egyéb eszközök				0,00
Összes eszköz			249 619 139	100,07
Kötelezettségek			-170 494	-0,07
Nettó eszközérték		100,00	249 448 645	100,00

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

II. FORGALOMBAN LÉVŐ BEFEKTETÉSI JEGYEK SZÁMA

Befektetési jegy				2018.12.30.	2019.06.28.
alap	sorozat	deviza	ISIN		
Himalája Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap	A	HUF	HU0000722277		250 000 000

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

III. AZ EGY BEFEKTETÉSI JEGYRE ESŐ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK

Befektetési jegy				2018.12.30.	2019.06.28.
alap	sorozat	deviza	ISIN		
Himalája Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap	A	HUF	HU0000722277		0.997795

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

IV. A BEFEKTETÉSI ALAP ÖSSZETÉTELE

Megnevezés	2018.12.30.		2019.06.28.	
	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 értékpapírok összesen				
Értékpapírok összesen			100,00	100,00

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

V. A NETTÓ ESZKÖZÉRTÉKNEK ÉS AZ EGY JEGYRE JUTÓ NETTÓ ESZKÖZÉRTÉNEK A VÁLTOZÁSA

Alap neve Fund	Sorozat Serie	Deviza Currency	ISIN	Nettó eszközérték Net Asset Value	1 jegyre jutó eszközérték Unit price	Értéknap Value date
Himalája Abszolút Hozamú Származtatott Befektetési Alap	A	HUF	HU0000722277	249 448 645	0,997795	2019.06.28

VI. SZÁRMAZTATOTT ÜGYLETEK

Az Alap 2019. első félévében nem tartalmazott származtatott ügyletet.

VII. A BEFEKTETÉSI ALAPKEZELŐ MŰKÖDÉSÉBEN BEKÖVETKEZETT VÁLTOZÁSOK, VALAMINT A BEFEKTETÉSI POLITIKA ALAKULÁSÁRA HATÓ FONTOSABB TÉNYEZŐK BEMUTATÁSA

A kötvénypiacokon továbbra is az alacsony hozamkörnyezet volt a meghatározó. A magyar állampapírpiacra a második negyedévben kis mértékben emelkedtek a hozamok, de a volatilitás nagyon alacsony maradt. A forint árfolyama is viszonylag szűk sávban mozgott 2019 első félévében. A FED kamatcsökkentésére vonatkozó várakozások megerősödésével jól teljesítettek a globális részvénypiacok az első félévben, 15%-nál nagyobb volt az emelkedés. A fejlődő piacok felett az USA-Kína kereskedelmi háború, az argentin és török bizonytalanságok miatt visszafogottabb, 9% körüli teljesítményt nyújtottak. A dollár a fejlődő piacokhoz képest magasabb kamatok és az USA robusztusabb növekedése miatt enyhén tovább erősödött, ami ugyancsak rányomta bélyegét a fejlődő piacon teljesítményére. Ugyanakkor a recessziós félelmek beindulásával júniusban a nemesfémek árfolyama is meglódult, a befektetói érdeklődés rendkívül megnövekedett a biztonságos befektetési alternatívák irányába.