



H O L D
A L A P K E Z E L Ő

Convexity Származtatott Részalap

Féléves jelentés

2022.

FÉLÉVES JELENTÉS

A Convexity Származtatott Részalap Féléves jelentése a 2014. évi XVI. törvény 6. számú melléklete alapján készült.

I. Vagyongkimutatás

Adatok Ft-ban

2021.12.31	Piaci érték	Portfólió arányában	Nettó eszközérték arányában
Átruházható értékpapírok	4,002,767,027	75.89%	80.06%
MÁK 2022/B	44,265,176	0.84%	0.89%
MÁK 2027/B	1,633,293,750	30.97%	32.67%
MÁK 2029/B	684,672,800	12.98%	13.69%
D220309	7,101,031	0.13%	0.14%
D220406	233,258,712	4.42%	4.67%
D220504	44,867,705	0.85%	0.90%
D220629	53,191,292	1.01%	1.06%
D220824	166,478,003	3.16%	3.33%
D221228	125,832,795	2.39%	2.52%
ALPHABET CL A	66,051,643	1.25%	1.32%
ALPHABET CL C	18,849,424	0.36%	0.38%
AMAZON	108,602,788	2.06%	2.17%
BARCLAYS IPATH BBG COFFEE B ETN	29,909,949	0.57%	0.60%
DAX EX (XTF)	124,186,950	2.35%	2.48%
FORD	67,649,967	1.28%	1.35%
INVESCO DYNAMIC LEISURE&ENT ETF	67,801,422	1.29%	1.36%
ISHARES MSCI JAPAN ETF	52,342,900	0.99%	1.05%
MICROSOFT	87,634,230	1.66%	1.75%
NOVO NORDISK SHS	30,993,848	0.59%	0.62%
PENN	50,664,191	0.96%	1.01%
PFIZER	48,082,939	0.91%	0.96%
SPDR S&P HOMEBUILDERS ETF	55,878,808	1.06%	1.12%
UNION PACIFIC	69,747,702	1.32%	1.40%
UTIL SECTOR	53,622,940	1.02%	1.07%
VANECK VECTORS AGRIBUSINESS ETF	62,158,496	1.18%	1.24%
WELLSFARGO	15,627,566	0.30%	0.31%
Banki egyenlegek	625,946,490	11.87%	12.52%
DKK	30,581,285	0.58%	0.61%
EUR	145,062,003	2.75%	2.90%
HUF	92,374,591	1.75%	1.85%
USD	357,928,611	6.79%	7.16%
Követelések (ügyfélszámla)	497,326,892	9.43%	9.95%
HUF	3,009	0.00%	0.00%
USD	497,323,883	9.43%	9.95%
Egyéb eszközök	148,356,711	2.81%	2.97%
Összes eszköz	5,274,397,120	100.00%	105.50%
Kötelezettségek	274,917,815	5.21%	5.50%
Kötelezettségek értékpapír vásárlásból	233,258,712	4.42%	4.67%
Alapkezelési díj	9,127,893	0.17%	0.18%
Sikerdíj	22,659,251	0.43%	0.45%
Letétkezelési díj	263,785	0.01%	0.01%
Felügyeleti díj	322,000	0.01%	0.01%
Könyvelési díj	191,248	0.00%	0.00%
Könyvvizsgálati díj	127,000	0.00%	0.00%
Forgalmazói díj	4,891,368	0.09%	0.10%

Befektetési alap különadója	455,000	0.01%	0.01%
Tranzakciós díj	33,000	0.00%	0.00%
Carrying cost	66,487	0.00%	0.00%
CFD Finance	150,458	0.00%	0.00%
Corporate Actions	3,361,835	0.06%	0.07%
Borrowing cost	9,778	0.00%	0.00%
Nettó eszközérték	4,999,479,305	94.79%	100.00%

Adatok Ft-ban

2022.06.30	Piaci érték	Portfolió arányában	Nettó eszközérték arányában
Átruházható értékpapírok	2,293,019,747	41.30%	41.52%
KAI DEALER FLOW ALPHA GEN SP	141,594,971	2.55%	2.56%
D220817	3,014,756	0.05%	0.05%
D220824	81,547,618	1.47%	1.48%
D220907	251,611,312	4.53%	4.56%
D221228	425,335,751	7.66%	7.70%
D230222	72,600,692	1.31%	1.31%
MOL 2.625% 2023/04/28	591,997,535	10.66%	10.72%
OTPB 2.875% 2029/07/15 CALL 240715	385,705,880	6.95%	6.98%
AMBEV ADR	47,688,745	0.86%	0.86%
BARCLAYS IPATH BBG COFFEE B ETN	35,515,765	0.64%	0.64%
FIX PRICE GROUP GDR REG S	7,143,812	0.13%	0.13%
GLOBAL X MSCI GREECE ETF	137,395,834	2.47%	2.49%
NOVO NORDISK SHS	35,690,861	0.64%	0.65%
UTIL SECTOR	61,292,007	1.10%	1.11%
WELLSFARGO	14,884,208	0.27%	0.27%
Banki egyenlegek	3,084,647,563	55.56%	55.85%
EUR	2,658,768,376	47.89%	48.14%
DKK	30,234,760	0.54%	0.55%
HUF	299,096,148	5.39%	5.42%
USD	96,548,279	1.74%	1.75%
Követelések (ügyfélszámla)	259,911,602	4.68%	4.71%
EUR	907,056	0.02%	0.02%
USD	259,004,546	4.67%	4.69%
Egyéb eszközök	-85,596,089	-1.54%	-1.55%
Összes eszköz	5,551,982,823	100.00%	100.52%
Kötelezettségek	28,989,744	0.52%	0.52%
Alapkezelési díj	14,088,395	0.25%	0.26%
Sikerdíj	4,288,063	0.08%	0.08%
Letétkezelési díj	304,078	0.01%	0.01%
Felügyeleti díj	491,000	0.01%	0.01%
Könyvelési díj	589,998	0.01%	0.01%

Könyvvizsgálati díj	392,430	0.01%	0.01%
Forgalmazói díj	8,105,780	0.15%	0.15%
Tranzakciós költség	30,000	0.00%	0.00%
Befektetési alap különadója	700,000	0.01%	0.01%
Nettó eszközérték	5,522,993,079	99.48%	100.00%

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

„A” sorozat: 4,175,478,609 db

„B” sorozat EUR: 475,714 db

„C” sorozat USD: 1,121,525 db

D” sorozat: 1,358,111,495 db

III. Egy Befektetési jegyre eső Nettó eszközérték

„A” sorozat: 0.908896 HUF/db

„B” sorozat: 0.873058 EUR/db

„C” sorozat: 0.876756 USD/db

„D” sorozat: 0.916211 HUF/db

IV. Befektetési alap összetétele

Befektetési Alap Összetétele

Megnevezés	Nyitó állomány (HUF)	NAV százalékában (%)	Záró állomány (HUF)	NAV százalékában (%)
Tőzsdén hivatalosan jegyzett értékpapírok	823,967,037	16.48%	1,179,918,813	21.15%
más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
egyéb átruházható értékpapírok	185,838,726	3.72%	278,990,805	5.00%
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	2,992,961,264	59.86%	834,110,129	14.95%
Származtatott pozíciók értéke	145,075,501	2.90%	-85,509,289	-1.53%
Nettó eszközérték	4,999,519,496	100.00%	5,577,818,652	100.00%

Az Alap befektetési politikájában, eszközeinek stratégiai összetételében jelentős változás nem történt.

Budapest, 2022. augusztus 24.

Móricz Dániel
Befektetési Igazgató
HOLD Alapkezelő Zrt.

Jelen dokumentum sajátkezű aláírásképet biztonsági okokból nem tartalmaz. Jelen dokumentum tartalma az eredeti, cégszerű aláírással ellátott dokumentum tartalmával mindenben egyező és sajátkezű aláírás nélkül is cégszerűen aláírtnak és hitelesnek tekinthető.