



H O L D
A L A P K E Z E L Ő

CITADELLA SZÁRMAZTATOTT
BEFEKTETÉSI ALAP

Féléves jelentés

2020.

FÉLÉVES JELENTÉS

Az Citadella Származtatott Befektetési Alap Féléves jelentése a 2014. évi XVI. törvény 6. számú melléklete alapján készült.

I. Vagyonkimutatás (adatok Ft-ban)

	2019.12.31			2020.06.30		
	Piaci érték	Portfolió arányában	Nettó eszközérték arányában	Piaci érték	Portfolió arányában	Nettó eszközérték arányában
Átruházható értékpapírok	29,476,722,827	69.08%	70.55%	22,631,965,794	51.23%	51.76%
Alpha Bank	1,654,313,548	3.88%	3.96%	652,157,117	1.48%	1.49%
Argentina 18.2% 2021/10/03	308,105,503	0.72%	0.74%	341,124,797	0.77%	0.78%
Argentina Float 2020/06/21	1,142,981,218	2.68%	2.74%	0	0.00%	0.00%
Boncer 1% 2021/08/05	0	0.00%	0.00%	786,440,052	1.78%	1.80%
D200429	34,401,135	0.08%	0.08%	0	0.00%	0.00%
D200624	2,659,872	0.01%	0.01%	0	0.00%	0.00%
D200819	0	0.00%	0.00%	57,045,735	0.13%	0.13%
D200826	164,215,419	0.38%	0.39%	173,760,464	0.39%	0.40%
D200923	0	0.00%	0.00%	406,227,280	0.92%	0.93%
D201021	1,999,758	0.00%	0.00%	63,434,838	0.14%	0.15%
D210224	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
EBRD 0% 2020/01/27	569,269,085	1.33%	1.36%	0	0.00%	0.00%
EBRD 31% 2021/03/01 MTN	1,734,097,872	4.06%	4.15%	1,218,386,115	2.76%	2.79%
Eurobank Holding SA	1,739,115,593	4.08%	4.16%	884,419,968	2.00%	2.02%
Fortenova Convertible Bond	277,380,845	0.65%	0.66%	214,756,136	0.49%	0.49%
Fortenova Depository Receipt	69,345,211	0.16%	0.17%	52,367,468	0.12%	0.12%
Ledo	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Mák 2020/A	0	0.00%	0.00%	14,437,248	0.03%	0.03%
MÁK 2020/N	525,514,382	1.23%	1.26%	0	0.00%	0.00%
MÁK 2020/O	6,053,085,412	14.19%	14.49%	0	0.00%	0.00%
MÁK 2020/P	8,478,199,916	19.87%	20.29%	9,348,483,271	21.16%	21.38%
Mák 2023/A	0	0.00%	0.00%	1,531,522,113	3.47%	3.50%
Mpc Container Ship	692,771,397	1.62%	1.66%	258,428,954	0.58%	0.59%
Natl Bank Of Greece Sa	2,700,849,468	6.33%	6.46%	1,279,729,159	2.90%	2.93%
US Treasury Bill 2020/02/27	617,534,120	1.45%	1.48%	0	0.00%	0.00%
US Treasury Bill 2020/03/12	852,275,784	2.00%	2.04%	0	0.00%	0.00%
US Treasury Bill 2020/03/26	925,483,558	2.17%	2.22%	0	0.00%	0.00%
US Treasury Bill 2020/04/09	933,123,731	2.19%	2.23%	0	0.00%	0.00%
US Treasury Bill 2020/07/16	0	0.00%	0.00%	667,412,298	1.51%	1.53%
US Treasury Bill 2020/07/30	0	0.00%	0.00%	921,618,516	2.09%	2.11%
US Treasury Bill 2020/08/13	0	0.00%	0.00%	1,001,334,111	2.27%	2.29%
US Treasury Bill 2020/08/27	0	0.00%	0.00%	1,010,179,494	2.29%	2.31%

CITADELLA SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP

Vaneck Vectors Gold Miners ETF	0	0.00%	0.00%	1,748,700,660	3.96%	4.00%
Banki egyenlegek	4,155,596,523	9.74%	9.95%	7,147,029,675	16.18%	16.35%
ARS	301,662,937	0.71%	0.72%	1,202,754	0.00%	0.00%
CZK	5,915	0.00%	0.00%	6,011	0.00%	0.00%
EUR	3,116,917,223	7.30%	7.46%	3,194,354	0.01%	0.01%
HRK	66,276	0.00%	0.00%	70,274	0.00%	0.00%
HUF	735,713,759	1.72%	1.76%	38,812,972	0.09%	0.09%
HUF (Lekötött Betét)	0	0.00%	0.00%	7,100,000,000	16.07%	16.24%
NOK	40,758	0.00%	0.00%	720,583	0.00%	0.00%
RON	33,230	0.00%	0.00%	35,413	0.00%	0.00%
RUB	4	0.00%	0.00%	4	0.00%	0.00%
USD	1,156,421	0.00%	0.00%	2,987,310	0.01%	0.01%
Követelések (ügyfélszámla)	6,538,249,493	15.32%	15.65%	11,200,762,640	25.35%	25.62%
EUR	3,510,495,765	8.23%	8.40%	6,819,556,568	15.44%	15.60%
USD	3,027,753,728	7.10%	7.25%	4,381,206,072	9.92%	10.02%
Egyéb eszközök	2,499,836,772	5.86%	5.98%	3,200,824,666	7.24%	7.32%
Összes eszköz	42,670,405,615	100.00%	102.13%	44,180,582,775	100.00%	101.05%
Kötelezettségek	889,511,397	2.08%	2.13%	459,925,267	1.04%	1.05%
Kötelezettségek értékpapír vásárlásból	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Kötelezettségek bizományosi jutalékból	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Kötelezettségek befektetési jegy visszaváltásból	1,044,935	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Kötelezettségek kölcsönkapott értékpapírból	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Alapkezelési díj	109,209,298	0.26%	0.26%	116,920,652	0.26%	0.27%
Sikerdíj	704,465,501	1.65%	1.69%	267,249,231	0.60%	0.61%
Letétkezelési díj	1,876,766	0.00%	0.00%	1,915,827	0.00%	0.00%
Felügyeleti díj	2,497,000	0.01%	0.01%	3,724,000	0.01%	0.01%
Könyvelési díj	428,400	0.00%	0.00%	496,806	0.00%	0.00%
Könyvvizsgálati díj	200,000	0.00%	0.00%	200,000	0.00%	0.00%
Forgalomban tartási díj	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Bizományosi díj	129,856	0.00%	0.00%	144,307	0.00%	0.00%
Forgalmazói díj	62,889,226	0.15%	0.15%	63,921,542	0.14%	0.15%
Bankköltség	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Befektetési alap különadója	4,937,000	0.01%	0.01%	5,317,000	0.01%	0.01%
Forgalmazási jutalék	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
ADR konverzió	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Banki kamat	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Borrowing cost	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Carrying cost	1,833,415	0.00%	0.00%	35,902	0.00%	0.00%
CFD Finance	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Commission	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Corporate Actions	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Deviza váltás eredménye	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Forex eredmény	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Holding Fee	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%

Kéler díj	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Opció nyitási díj terhelés	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Nettó eszközérték	41,780,894,218	97.92%	100.00%	43,720,657,508	98.96%	100.00%

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

„A” sorozat 16,776,575,538 db

„B” sorozat 3,474,732,589 db

III. Egy Befektetési jegyre eső Nettó eszközérték (befektetési jegy névértéke 1 HUF)

„A” sorozat 2.367988

„B” sorozat 1.149477

IV. Befektetési alap összetétele

Befektetési Alap Összetétele				
Megnevezés	Nyitó állomány (HUF)	NAV százalékában (%)	Záró állomány (HUF)	NAV százalékában (%)
Tőzsdén hivatalosan jegyzett értékpapírok	9,437,143,019	22.59%	4,560,244,917	10.43%
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	0	0.00%	1,748,700,660	4.00%
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	21,730,635,611	52.01%	18,194,879,592	41.62%
Származtatott pozíciók értéke	445,129,152	1.07%	102,525,016	0.23%
Nettó eszközérték	41,780,562,895	100.00%	43,720,854,747	100.00%

Az Alap befektetési politikája változott, módosultak a befektetési limitek.

Budapest, 2020. 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.