



CITADELLA SZÁRMAZTATOTT
BEFEKTETÉSI ALAP

Féléves jelentés
2024.

FÉLÉVES JELENTÉS

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

I. Vagyonkimutatás

Adatok Ft-ban

2023.12.31	Piaci érték	Portfólió arányában	Nettó eszközérték arányában
Atruházható értékpapírok	44 106 764 163	70,53%	72,61%
ALPHA BANK	2 681 241 400	4,29%	4,41%
BANCA TRANSILVANIA 8.875% 2027/04/27	1 003 849 143	1,61%	1,65%
CAIRO MEZZ ORD	35 293 333	0,06%	0,06%
EUROBANK HOLDINGS SA	4 416 417 266	7,06%	7,27%
EXIM 2024/6	779 842 000	1,25%	1,28%
FOURLIS	275 601 600	0,44%	0,45%
FRANCE TREASURY BILL 2024/06/12	3 060 027 991	4,89%	5,04%
FRANCE TREASURY BILL 2024/07/10	2 518 001 099	4,03%	4,14%
FRANCE TREASURY BILL 2024/09/04	1 720 659 641	2,75%	2,83%
FRANCE TREASURY BILL 2024/10/02	1 716 750 692	2,75%	2,83%
GALAXY COSMOS MEZZ PLC	39 508 720	0,06%	0,07%
HOLD DEEP TURTLE CLASS D4 - EUR	11 210 382 186	17,93%	18,45%
MÁK 2024/C	125 952 190	0,20%	0,21%
MÁK 2027/B	3 661 280 328	5,85%	6,03%
MÁK 2029/B	3 061 359 000	4,90%	5,04%
MFBEU2406/1	1 840 820 255	2,94%	3,03%
NATL BANK OF GREECE SA	4 723 425 272	7,55%	7,78%
PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS	1 224 896 000	1,96%	2,02%
SUNRISEMEZZ PLC	11 456 047	0,02%	0,02%
Banki egyenlegek	7 729 229 699	12,36%	12,72%
AED	0	0,00%	0,00%
ARS	6 030	0,00%	0,00%
CZK	6 708	0,00%	0,00%
EUR	7 476 173 360	11,96%	12,31%
HUF	247 418 657	0,40%	0,41%
NOK	18 722	0,00%	0,00%
PLN	550 092	0,00%	0,00%
RON	37 015	0,00%	0,00%
USD	5 019 115	0,01%	0,01%
Követelések (ügyfélszámla)	6 041 672 005	9,66%	9,95%
AED	0	0,00%	0,00%
EUR	3 635 091 288	5,81%	5,98%
USD	2 406 580 717	3,85%	3,96%
Egyéb eszközök	4 656 137 620	7,45%	7,66%
Követelések értékpapír eladásból	0	0,00%	0,00%
Követelések értékpapír kölcsönadásból	0	0,00%	0,00%
Követelések értékpapír kölcsönadásból értékkülönbözete	0	0,00%	0,00%
Követelések befektetési jegy visszaváltásból	65 716 925	0,11%	0,11%
Egyéb követelés	0	0,00%	0,00%
Határidős ügyletek változó letét	4 013 227 649	6,42%	6,61%
Származtatott ügyletek	577 193 046	0,92%	0,95%
Aktív időbeli elhatárolások	0	0,00%	0,00%
Összes ESZKŐZ	62 533 803 487	100,00%	102,94%
Kötelezettségek	1 785 483 247	2,86%	2,94%
Kötelezettségek értékpapír vásárlásból	0	0,00%	0,00%
Kötelezettségek bizományosi jutalékból	0	0,00%	0,00%
Kötelezettségek befektetési jegy visszaváltásból	0	0,00%	0,00%

Kötelezettségek kölcsönkapott értékpapírból	0	0,00%	0,00%
Felügyeleti díj	5 132 000	0,01%	0,01%
Alapkezelői díj	160 531 923	0,26%	0,26%
Letétkezelői díj	2 746 800	0,00%	0,00%
Bizományosi díj	124 834	0,00%	0,00%
Forgalmazási díj	92 160 368	0,15%	0,15%
Sikerdíj	1 515 749 645	2,42%	2,50%
Könyvelési díj	625 000	0,00%	0,00%
Könyvvizsgálói díj	485 000	0,00%	0,00%
Határidős ügyletek jutaléka	0	0,00%	0,00%
Különadó	7 328 000	0,01%	0,01%
Carrying Cost	599 677	0,00%	0,00%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	60 748 320 240	97,14%	100,00%

2024.06.30	Piaci érték	Portfólió arányában	Nettó eszközérték arányában
Átruházható értékpapírok	64,829,712,287	76.59%	77.95%
DKJ241223	970,450,000	1.15%	1.17%
MAK 2024/C	8,077,731,516	9.54%	9.71%
MAK 2027/B	3,563,892,396	4.21%	4.29%
MAK 2029/B	2,998,446,000	3.54%	3.61%
MNB240704	8,111,603,920	9.58%	9.75%
BTF 0 07/10/24	2,645,413,471	3.13%	3.18%
BTF 0 09/04/24	1,805,929,546	2.13%	2.17%
BTF 0 10/02/24	1,801,039,960	2.13%	2.17%
BANCA TRANSILV 8 7/8 04/27/27	994,955,792	1.18%	1.20%
ALPHA SERVICES AND HOLDINGS SA	2,740,012,244	3.24%	3.29%
CAIRO MEZZ PLC.	73,668,504	0.09%	0.09%
EUROBANK HOLDINGS SA.	5,722,993,922	6.76%	6.88%
FOURLIS HOLDINGS SA	275,972,760	0.33%	0.33%
GALAXY COSMOS MEZZ PLC	52,159,933	0.06%	0.06%
NATIONAL BANK OF GREECE SA (CR	6,034,231,656	7.13%	7.26%
PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S.A.(CR)	1,345,880,900	1.59%	1.62%
SUNRISEMEZZ PLC (CR)	16,765,633	0.02%	0.02%
CONCORDE DEEP TURTLE CL D4 - EUR	13,056,508,708	15.43%	15.70%
RB POSITION SP CLASS D	4,542,055,426	5.37%	5.46%
Banki egyenlegek	11,735,160,141	13.86%	14.11%
CZK	6,806	0.00%	0.00%
EUR	1,968,675,665	2.33%	2.37%
HUF	9,759,758,424	11.53%	11.73%
NOK	19,052	0.00%	0.00%
PLN	572,523	0.00%	0.00%
RON	38,189	0.00%	0.00%
USD	6,089,482	0.01%	0.01%
Követelések (ügyfélszámla)	8,456,924,297	319.68%	10.17%
ARS	4,625	0.00%	0.00%
EUR	5,236,645,203	6.19%	6.30%
USD	3,220,274,469	3.80%	3.87%

Egyéb eszközök	-377,363,356	-0.45%	-0.45%
Összes eszköz	84,644,433,369	100.00%	101.77%
Kötelezettségek	1,474,596,444	1.74%	1.77%
Kötelezettségek befektetési jegy visszaváltásból	14,385,963	0.02%	0.02%
Alapkezelési díj	325,229,770	0.38%	0.39%
Sikerdíj	1,113,311,840	1.32%	1.34%
Letétkezelési díj	3,399,593	0.00%	0.00%
Felügyeleti díj	6,656,586	0.01%	0.01%
Könyvelési díj	1,342,219	0.00%	0.00%
Könyvvizsgálati díj	366,267	0.00%	0.00%
Befektetési alap különadója	9,561,664	0.01%	0.01%
Carring cost	342,542	0.00%	0.00%
Nettó eszközérték	83,169,836,925	98.26%	100.00%

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

„A” sorozat 19,312,867,862 db

„B” sorozat 2,097,721,692 db

„C” sorozat 30,920,837 db

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

„A” sorozat (befektetési jegy névértéke 1 HUF) 3.401134

„B” sorozat (befektetési jegy névértéke 1 HUF) 1.700989

„C” sorozat (befektetési jegy névértéke 1 EUR) 1.138940

IV. Befektetési alap összetétele

Befektetési alap összetétele				
Megnevezés	Nyitó állomány (Ft)	NEÉ százalékában (%)	Záró állomány (Ft)	NEÉ százalékában (%)
Tőzsdén hivatalosan jegyzett értékpapírok	17,032,351,036	28.04%	17,256,641,344	20.75%
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	11,210,382,186	18.45%	17,598,564,134	21.16%
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	15,864,030,941	26.11%	29,974,506,809	36.04%
Származtatott pozíciók értéke	577,193,046	0.95%	-447,256,392	-0.54%
Nettó eszközérték (NEÉ)	60,748,405,416	100.00%	83,169,841,938	100.00%

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

Budapest, 2024. augusztus 28.

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.