



## Convexity Származtatott Részalap

Féléves jelentés

2024.

## FÉLÉVES JELENTÉS

A Convexity Származtatott Részalap 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
<b>Átruházható értékpapírok</b>	<b>3,549,009,920</b>	<b>75.87%</b>	<b>76.43%</b>
NAT BANK GREECE 8% 2034/01/03	186,819,473	3.99%	4.02%
SLOVENIA 5% 2033/09/19	1,073,979,243	22.96%	23.13%
BANCA TRANSILVANIA 7.25% 2028/12/07	126,790,700	2.71%	2.73%
CESKA SPORITELNA 5.737% 2028/03/08	120,821,330	2.58%	2.60%
MAEXIM 6% 2029/05/16 CALL 2029/04/16	368,519,646	7.88%	7.94%
MBANK 8.375% 2027/09/11	206,994,027	4.43%	4.46%
MBH BANK 8.625% 2027/10/19 CALL 2026	142,948,253	3.06%	3.08%
OTPHB 6.125% 2027/10/05	361,840,441	7.74%	7.79%
PEKAO 5.5% 2027/11/23 CALL 2026/11/23	137,753,718	2.95%	2.97%
PIRAEUS BANK 6.75% 2029/12/05 C2028	80,837,394	1.73%	1.74%
COCA-COLA FEMSA SAB - ADR	98,361,245	2.10%	2.12%
FIX PRICE GROUP GDR REG S	11,043,252	0.24%	0.24%
ISHARES MSCI BRAZIL SMALL CAP ETF	65,217,330	1.39%	1.40%
ISHARES MSCI MEXICO	82,270,839	1.76%	1.77%
M&T BANK ORD	94,979,990	2.03%	2.05%
NOVO NORDISK B ORD	215,156,305	4.60%	4.63%
NU HOLDINGS CL A ORD	43,287,678	0.93%	0.93%
KAI DEALER FLOW APLHA GEN SP	131,389,056	2.81%	2.83%
<b>Banki egyenlegek</b>	<b>804,848,471</b>	<b>17.21%</b>	<b>17.33%</b>
DKK	686,880	0.01%	0.01%
EUR	377,992,605	8.08%	8.14%
HUF	5,779,743	0.12%	0.12%
USD	420,389,243	8.99%	9.05%
<b>Követelések (ügyfélszámla)</b>	<b>316,701,469</b>	<b>6.77%</b>	<b>6.82%</b>
USD	316,701,469	6.77%	6.82%
<b>Egyéb eszközök</b>	<b>6,930,699</b>	<b>0.15%</b>	<b>0.15%</b>
<b>Összes eszköz</b>	<b>4,677,490,559</b>	<b>100.00%</b>	<b>100.74%</b>
<b>Kötelezettségek</b>	<b>34,280,545</b>	<b>0.73%</b>	<b>0.74%</b>
Kötelezettségek befektetési jegy visszaváltásból	7,946,071	0.17%	0.17%
Alapkezelési díj	12,083,103	0.26%	0.26%
Letétkezelési díj	261,162	0.01%	0.01%
Felügyeleti díj	414,000	0.01%	0.01%
Könyvelési díj	274,999	0.01%	0.01%
Könyvvizsgálati díj	517,665	0.01%	0.01%
Forgalmazói díj	5,963,849	0.13%	0.13%
Befektetési alap különadója	592,000	0.01%	0.01%
Carrying cost	209,936	0.00%	0.00%
CFD Finance	5,753,173	0.12%	0.12%
Corporate Actions	56,913	0.00%	0.00%
Borrowing cost	207,674	0.00%	0.00%
<b>Nettó eszközérték</b>	<b>4,643,210,014</b>	<b>99.27%</b>	<b>100.00%</b>

Adatok Ft-ban

2024.06.30	Piaci érték	Portfólió arányában	Nettó eszközérték arányában
<b>Átruházható értékpapírok</b>	<b>3,663,571,398</b>	<b>80.16%</b>	<b>80.76%</b>
KAI DEALER FLOW APLHA GEN SP	137,269,255	3.00%	3.03%
BANCA TRANSILVANIA 7.25% 2028/12/07	136,907,779	3.00%	3.02%
ENGIE 4.25% 2044/03/06	116,595,409	2.55%	2.57%
KPN 3.875% 2036/02/16	276,868,051	6.06%	6.10%
MAEXIM 6% 2029/05/16 CALL 2029/04/16	376,819,466	8.24%	8.31%
MNB240704	449,534,700	9.84%	9.91%
COCA COLA	188,098,480	4.12%	4.15%
COCA-COLA FEMSA SAB - ADR	47,563,944	1.04%	1.05%
EMBRAER ADR	14,295,780	0.31%	0.32%
ESTABLISHMENT LABS HOLDINGS ORD	27,696,134	0.61%	0.61%
FIX PRICE GROUP GDR REG S	13,597,069	0.30%	0.30%
ISHARES MSCI MEXICO	73,191,069	1.60%	1.61%
M&T BANK ORD	111,824,768	2.45%	2.47%
MCDONALDS	75,310,317	1.65%	1.66%
NOVO NORDISK B ORD	319,827,037	7.00%	7.05%
NU HOLDINGS CL A ORD	71,423,490	1.56%	1.57%
PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS	21,321,445	0.47%	0.47%
UNIVERSAL TECHNICAL INSTITUTE ORD	33,701,840	0.74%	0.74%
US STEEL	48,871,620	1.07%	1.08%
VIKING THERAPEUTICS	5,874,568	0.13%	0.13%
INDONESIA 5.1% 2054/02/10 CALL 530810	71,724,920	1.57%	1.58%
TURKEY 5.875% 2030/05/21	1,045,254,257	22.87%	23.04%
<b>Banki egyenlegek</b>	<b>459,081,694</b>	<b>10.04%</b>	<b>10.12%</b>
EUR	22,760,600	0.50%	0.50%
HUF	60,009,731	1.31%	1.32%
USD	376,311,363	8.23%	8.30%
<b>Követelések (ügyfélszámla)</b>	<b>307,929,689</b>	<b>6.74%</b>	<b>6.79%</b>
EUR	-23,811,739	-0.52%	-0.52%
USD	331,741,428	7.26%	7.31%
<b>Egyéb eszközök</b>	<b>139,899,685</b>	<b>3.06%</b>	<b>3.08%</b>
<b>Összes eszköz</b>	<b>4,570,482,466</b>	<b>100.00%</b>	<b>100.76%</b>
<b>Kötelezettségek</b>	<b>34,362,006</b>	<b>0.75%</b>	<b>0.76%</b>
Kötelezettségek befektetési jegy visszaváltásból	5,511,131	0.12%	0.12%
Alapkezelési díj	11,733,966	0.26%	0.26%
Sikerdíj	9,653,578	0.21%	0.21%
Letétkezelési díj	241,827	0.01%	0.01%
Felügyeleti díj	405,000	0.01%	0.01%
Könyvelési díj	450,000	0.01%	0.01%
Könyvvizsgálati díj	528,415	0.01%	0.01%
Forgalmazói díj	5,152,326	0.11%	0.11%
Tranzakciós költség	14,000	0.00%	0.00%
Befektetési alap különadója	581,000	0.01%	0.01%
Corporate Actions	90,763	0.00%	0.00%
<b>Nettó eszközérték</b>	<b>4,536,120,460</b>	<b>99.25%</b>	<b>100.00%</b>

## II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

„A” sorozat: 1,689,440,452 db

„B” sorozat EUR: 385,617 db

„C” sorozat USD: 1,954,017 db

D” sorozat: 1,560,255,544 db

## III. Egy Befektetési jegyre eső Nettó eszközérték

„A” sorozat: 1.124585 HUF/db

„B” sorozat: 0.899473 EUR/db

„C” sorozat: 0.963757 USD/db

„D” sorozat: 1.156143 HUF/db

## IV. Befektetési alap összetétele

Befektetési alap összetétele				
Megnevezés	Nyitó állomány (Ft)	NEÉ százalékában (%)	Záró állomány (Ft)	NEÉ százalékában (%)
Tőzsdén hivatalosan jegyzett értékpapírok	2,774,822,349	59.75%	2,418,124,209	53.30%
más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	126,790,700	2.73%	136,907,779	3.02%
egyéb átruházható értékpapírok	278,877,225	6.01%	210,460,324	4.64%
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	368,519,646	7.94%	898,079,086	19.80%
Származtatott pozíciók értéke	-349,975	-0.01%	78,398,541	1.73%
Nettó eszközérték (NEÉ)	4,643,837,307	100.00%	4,536,509,694	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.