



HOLD EXPEDÍCIÓ SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP

Féléves jelentés

2024.

FÉLÉVES JELENTÉS

A HOLD Expedíció Származtatott Befektetési Alap Féléves jelentése a 2014. évi XVI. törvény 6. számú melléklete alapján készült.

I. Vagyongkimutatás

Adatok Ft-ban

2023.12.31	Piaci érték	Portfólió arányában	Nettó eszközérték arányában
Átruházható értékpapírok	6 444 347 134	93,55%	94,03%
ADVENTUM MAGIS ZARTKORU A. ALAPJA NYILT VEGU BEFJEGY E	153 184 623	2,22%	2,24%
ADVENTUM SATIS EUR ZARTK. A. ALAPJA	82 603 933	1,20%	1,21%
AP MOLLER MAERSK B ORD	57 351 788	0,83%	0,84%
BANCA TRANSILVANIA 8.875% 2027/04/27	363 094 371	5,27%	5,30%
BILFINGER BERGER AG	43 117 373	0,63%	0,63%
CAIRO MEZZ ORD	971 561	0,01%	0,01%
DEEP VALUE DRILLER ORD	60 745 837	0,88%	0,89%
DIGI	67 807 417	0,98%	0,99%
ERSTE BANK STAMMAKT	196 833 132	2,86%	2,87%
EUROBANK HOLDINGS SA	198 785 922	2,89%	2,90%
EVN AG	54 450 455	0,79%	0,79%
EXIM 2024/2	80 933 930	1,17%	1,18%
FIX PRICE GROUP GDR REG S	98 990 050	1,44%	1,44%
FOURLIS	130 145 200	1,89%	1,90%
FRANCE TREASURY BILL 2024/01/17	764 495 872	11,10%	11,15%
FRANCE TREASURY BILL 2024/01/24	573 004 435	8,32%	8,36%
FRESENIUS SE	12 893 562	0,19%	0,19%
GSK ADR REP 2 ORD	25 601 098	0,37%	0,37%
GSK ORD	6 230 428	0,09%	0,09%
JUMBO R	115 865 975	1,68%	1,69%
KERNEL HOLDING 6.5% 2024/10/17	132 744 258	1,93%	1,94%
KOMAL2025 KÖTVÉNY	39 253 859	0,57%	0,57%
KRANESHARES CSI CHINA INTERNET ETF	11 224 656	0,16%	0,16%
LINAMAR CORP	175 742 582	2,55%	2,56%
MAERSK A ORD	42 446 937	0,62%	0,62%
MAGYAR TELEKOM	210 056 000	3,05%	3,06%
MÁK 2027/B	208 703 800	3,03%	3,05%
MAYR MELNHOF KARTON	48 459 948	0,70%	0,71%
MO BRUK SA	30 598 302	0,44%	0,45%
MOLHB 1.5% 2027/10/08	139 727 408	2,03%	2,04%
MPC CONTAINER SHIP	91 619 830	1,33%	1,34%
NATL BANK OF GREECE SA	154 932 199	2,25%	2,26%
NOVA KREDITNA BANK 7.375 26/06/29 C25	164 111 260	2,38%	2,39%
ORIGIN ENTERPRISES ORD	312 894 539	4,54%	4,57%
OTP	110 600 000	1,61%	1,61%
OTPHB 5.5% 2025/07/13	310 463 421	4,51%	4,53%
PEPCO 7.25% 2028/07/01	163 565 416	2,37%	2,39%
PEPCO GROUP ORD	222 319 841	3,23%	3,24%
UBS GROUP NAMEN-AKT.	86 084 064	1,25%	1,26%
US TREASURY 0.125% 2052/02/15	194 929 313	2,83%	2,84%
VALARIS ORD	71 266 172	1,03%	1,04%
VANECK VECTORS GOLD MINERS ETF	36 848 848	0,53%	0,54%
VIENNA INSURANCE GROUP	167 370 555	2,43%	2,44%
VK COMPANY LIMITED - GDR	11 328 795	0,16%	0,17%
VOLKSWAGEN ELS.	71 039 375	1,03%	1,04%
WIZZ AIR	148 908 794	2,16%	2,17%

Banki egyenlegek	214 952 379	3,12%	3,14%
AED	0	0,00%	0,00%
ARS	-144	0,00%	0,00%
CAD	1 963 506	0,03%	0,03%
CHF	171 574	0,00%	0,00%
CZK	21 549	0,00%	0,00%
DKK	244 289	0,00%	0,00%
EUR	81 158 570	1,18%	1,18%
GBP	401 673	0,01%	0,01%
HUF	121 462 806	1,76%	1,77%
NOK	7 961 535	0,12%	0,12%
PLN	391 902	0,01%	0,01%
RON	47 751	0,00%	0,00%
TRY	30 175	0,00%	0,00%
USD	1 088 480	0,02%	0,02%
ZAR	8 713	0,00%	0,00%
Követelések (ügyszámla)	153 021 402	2,22%	2,23%
AED	0	0,00%	0,00%
EUR	10 617 670	0,15%	0,15%
USD	142 403 732	2,07%	2,08%
Egyéb eszközök	76 458 442	1,11%	1,12%
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	22 684 587	0,33%	0,33%
Egyéb követelés	0	0,00%	0,00%
Határidős ügyletek változó letét	-876 690	-0,01%	-0,01%
Származtatott ügyletek	49 974 311	0,73%	0,73%
Aktív időbeli elhatárolások	4 676 234	0,07%	0,07%
Összes ESZKÖZ	6 888 779 357	100,00%	100,51%
Kötelezettségek	35 260 378	0,51%	0,51%
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	551 000	0,01%	0,01%
Alapkezelői díj	29 242 149	0,42%	0,43%
Letétkezelői díj	362 893	0,01%	0,01%
Bizományosi díj	17 000	0,00%	0,00%
Forgalmazási díj	1 661 811	0,02%	0,02%
Sikerdíj	0	0,00%	0,00%
Könyvelési díj	274 999	0,00%	0,00%
Könyvvizsgálói díj	239 666	0,00%	0,00%
Határidős ügyletek jutaléka	0	0,00%	0,00%
Különadó	758 000	0,01%	0,01%
Borrowing cost	18 507	0,00%	0,00%
CFD Finance	2 069 319	0,03%	0,03%
Carrying Cost	65 034	0,00%	0,00%
NETTÓ ESZKÖZÉRTÉK	6 853 518 979	99,49%	100,00%

2024.06.30	Piaci érték	Portfólió arányában	Nettó eszközérték arányában
Átruházható értékpapírok	10,890,594,820	77.70%	78.05%
2027/B MÁK	203,152,400	1.45%	1.46%
MNB240704	1,298,655,800	9.27%	9.31%
USTRE 320115	252,986,837	1.80%	1.81%
KERN 241017	157,852,429	1.13%	1.13%
PEU FIN EUR	170,244,687	1.21%	1.22%
PKN PW	209,642,293	1.50%	1.50%

PEO PW	66,193,512	0.47%	0.47%
OTP DEMAT	64,137,500	0.46%	0.46%
MRSK DK	175,755,642	1.25%	1.26%
ERSTE BANK	163,451,427	1.17%	1.17%
MTELEKOM	222,372,000	1.59%	1.59%
VOW3 GY PREF	69,137,025	0.49%	0.50%
PKO BANK	115,307,192	0.82%	0.83%
RIBH	118,412,427	0.84%	0.85%
INDEPENDENCE	76,110,672	0.54%	0.55%
POWSZECHNY	74,735,306	0.53%	0.54%
VIENNA INSUR	455,568,435	3.25%	3.26%
MAYRMELN	147,457,335	1.05%	1.06%
WIZZ LN	275,037,917	1.96%	1.97%
GBF GY	62,765,033	0.45%	0.45%
ALPHAINC	264,434,805	1.89%	1.90%
EUROB GA	257,595,819	1.84%	1.85%
RYANAIR EUR	245,206,381	1.75%	1.76%
DIGI RO	859,757,578	6.13%	6.16%
MPCCONTAINER	114,446,778	0.82%	0.82%
MAERSKA DC	157,211,792	1.12%	1.13%
NBK GRE II.	197,927,717	1.41%	1.42%
FOURLIS	130,320,470	0.93%	0.93%
LNR CN	333,269,689	2.38%	2.39%
BELA GA	127,990,666	0.91%	0.92%
OGN ID	644,910,785	4.60%	4.62%
NLB EU	65,199,750	0.47%	0.47%
CAIRO MEZZ	75,462,636	0.54%	0.54%
MBR PW	97,459,959	0.70%	0.70%
PIRAEUS 3032	42,642,890	0.30%	0.31%
PCO PW	186,102,729	1.33%	1.33%
VAL US	332,995,630	2.38%	2.39%
GSK GB	7,032,761	0.05%	0.05%
GSK US	28,358,469	0.20%	0.20%
VKCO RM	30,233,453	0.22%	0.22%
SUNRISEMEZZ	16,665,056	0.12%	0.12%
GALAXY COSMO	15,982,237	0.11%	0.11%
SVITZR DC	14,441,232	0.10%	0.10%
KOMAL 250516	39,585,732	0.28%	0.28%
USTRE 520215	446,961,416	3.19%	3.20%
WINGHOLD27/I	153,342,431	1.09%	1.10%
FIXP RM	121,882,089	0.87%	0.87%
MOL271008	147,327,726	1.05%	1.06%
OTP 250713	326,656,540	2.33%	2.34%
VBTC GY	51,874,897	0.37%	0.37%
BT 270427	359,877,627	2.57%	2.58%
NOVAKR260629	173,802,460	1.24%	1.25%

ISHAR.KOREA	144,040,511	1.03%	1.03%
ADV MAGIS	158,924,035	1.13%	1.14%
KWEB LN	12,000,897	0.09%	0.09%
ADV SATIS E	86,757,872	0.62%	0.62%
G2X GY USD	42,935,436	0.31%	0.31%
Banki egyenlegek	2,905,154,087	20.73%	20.82%
AUD	1,484,428	0.01%	0.01%
CAD	3,724,232	0.03%	0.03%
CHF	170,904	0.00%	0.00%
CZK	21,994	0.00%	0.00%
DKK	28,862	0.00%	0.00%
EUR	20,180,448	0.14%	0.14%
GBP	489,749	0.00%	0.00%
HUF	2,803,851,109	20.00%	20.09%
NOK	122,186	0.00%	0.00%
PLN	607,423	0.00%	0.00%
RON	8,682	0.00%	0.00%
TRY	129,985	0.00%	0.00%
USD	74,334,085	0.53%	0.53%
Követelések (ügyfélszámla)	115,949,084	55.31%	0.83%
ARS	434	0.00%	0.00%
EUR	26,505,891	0.19%	0.19%
USD	89,442,759	0.64%	0.64%
Egyéb eszközök	104,386,021	0.74%	0.75%
Összes eszköz	14,016,084,012	100.00%	100.45%
Kötelezettségek	62,200,252	0.44%	0.45%
Alapkezelési díj	58,289,448	0.42%	0.42%
Letétkezelési díj	663,988	0.00%	0.00%
Felügyeleti díj	1,046,211	0.01%	0.01%
Könyvelési díj	444,383	0.00%	0.00%
Könyvvizsgálati díj	283,146	0.00%	0.00%
Befektetési alap különadója	1,473,076	0.01%	0.01%
Nettó eszközérték	13,953,883,760	99.56%	100.00%

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

„A” sorozat	5,412,360,564 db
„B” sorozat	4,787,665 db

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

„A” sorozat (befektetési jegy névértéke 1 HUF)	2.173035
„B” sorozat (befektetési jegy névértéke 1 EUR)	1.158991

IV. Befektetési alap összetétele

Befektetési alap összetétele				
Megnevezés	Nyitó állomány (Ft)	NEÉ százalékában (%)	Záró állomány (Ft)	NEÉ százalékában (%)
Tőzsdén hivatalosan jegyzett értékpapírok	4,430,576,310	64.65%	8,192,304,719	58.71%
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	272,637,404	3.98%	496,533,648	3.56%
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	1,741,133,420	25.40%	2,201,756,453	15.78%
Származtatott pozíciók értéke	49,974,311	0.73%	-7,861,214	-0.06%
Nettó eszközérték (NEÉ)	6,853,533,133	100.00%	13,953,881,224	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.