



Convexity Származtatott Részalap

Féléves jelentés
2023.

FÉLÉVES JELENTÉS

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

I. Vagyongkimutatás

Adatok Ft-ban

2022.12.31	Piaci érték	Portfólió arányában	Nettó eszközérték arányában
Átruházható értékpapírok	2,799,973,490	53.88%	54.16%
KAI DEALER FLOW APLHA GEN SP	130,047,992	2.50%	2.52%
MICROSOFT 2.375% 2023/05/01	187,543,588	3.61%	3.63%
MFBEU2406/1	478,804,262	9.21%	9.26%
MOL 2.625% 2023/04/28	467,110,802	8.99%	9.04%
MVM ENERGETIKA 0.875% 2027/11/18	143,305,710	2.76%	2.77%
OTPHB 5.5% 2025/07/13	100,493,469	1.93%	1.94%
OTPHB 7.35% 2026/03/04 CALL 25/03/04	386,188,643	7.43%	7.47%
RAIFFEISEN 8.75% 2025/11/22 CALL 2024	249,140,976	4.79%	4.82%
AMBEV ADR	51,092,480	0.98%	0.99%
FIX PRICE GROUP GDR REG S	6,616,761	0.13%	0.13%
NOVO NORDISK SHS	292,907,225	5.64%	5.67%
WELLSFARGO	15,511,827	0.30%	0.30%
REPHUN 5.375% 2024/03/25	152,451,545	2.93%	2.95%
ROMANIA 2.875% 2024/10/28	138,758,210	2.67%	2.68%
Banki egyenlegek	1,685,526,595	32.43%	32.60%
DKK	18,973	0.00%	0.00%
EUR	1,511,442,053	29.08%	29.24%
HUF	34,420,568	0.66%	0.67%
USD	139,645,001	2.69%	2.70%
Követelések (ügyfélszámla)	476,093,347	9.16%	9.21%
HUF	0	0.00%	0.00%
USD	476,093,347	9.16%	9.21%
Egyéb eszközök	235,081,570	4.52%	4.55%
Összes eszköz	5,196,675,002	100.00%	100.52%
Kötelezettségek	27,100,271	0.52%	0.52%
Kötelezettségek értékpapír vásárlásból	0	0.00%	0.00%
Alapkezelési díj	13,192,640	0.25%	0.26%
Letétkezelési díj	285,994	0.01%	0.01%
Felügyeleti díj	452,000	0.01%	0.01%
Könyvelési díj	294,999	0.01%	0.01%
Könyvvizsgálati díj	467,360	0.01%	0.01%
Forgalmazói díj	7,068,789	0.14%	0.14%
Befektetési alap különadója	645,000	0.01%	0.01%
Carrying cost	108,635	0.00%	0.00%
CFD Finance	4,584,854	0.09%	0.09%
Nettó eszközérték	5,169,574,731	99.48%	100.00%

2023.06.30	Piaci érték	Portfólió arányában	Nettó eszközérték arányában
Átruházható értékpapírok	3,039,179,537	70.55%	70.90%
KAI DEALER FLOW APLHA GEN SP	127,206,775	2.95%	2.97%
MFBEU2406/1	228,355,493	5.30%	5.33%
BANCA COMERCIALA 7.625% 2027/05/19	114,968,651	2.67%	2.68%
BANCA TRANSILVANIA 8.875% 2027/04/27	232,540,186	5.40%	5.43%
MVM 7.5% 2028/06/09	274,822,566	6.38%	6.41%
MVM ENERGETIKA 0.875% 2027/11/18	147,895,305	3.43%	3.45%
OTPHB 7.5% 2027/05/25 CALL 26/05/25	207,081,876	4.81%	4.83%
RAIFFEISEN 7.125% 2026/01/19 C250119	381,971,821	8.87%	8.91%
RAIFFEISEN 7.875% 2027/06/05 C260605	228,817,010	5.31%	5.34%
RAIFFEISEN 8.75% 2025/11/22 CALL 2024	241,605,630	5.61%	5.64%
COCA-COLA FEMSA SAB - ADR	85,576,032	1.99%	2.00%
FIX PRICE GROUP GDR REG S	5,599,199	0.13%	0.13%
ISHARES MSCI MEXICO	74,516,512	1.73%	1.74%
M&T BANK ORD	84,750,848	1.97%	1.98%
NOVO NORDISK SHS	263,066,455	6.11%	6.14%
NU HOLDINGS CL A ORD	40,523,040	0.94%	0.95%
ROMANIA 7.125% 2033/01/17	299,882,138	6.96%	7.00%
Banki egyenlegek	221,792,457	5.15%	5.17%
EUR	46,913,460	1.09%	1.09%
DKK	92,977	0.00%	0.00%
HUF	2,440,065	0.06%	0.06%
USD	172,345,955	4.00%	4.02%
Követelések (ügyfélszámla)	366,787,525	8.51%	8.56%
EUR	-4,498,096	-0.10%	-0.10%
USD	371,285,621	8.62%	8.66%
Egyéb eszközök	680,256,680	15.79%	15.87%
Összes eszköz	4,308,016,199	100.00%	100.51%
Kötelezettségek	21,705,066	0.50%	0.51%
Alapkezelési díj	11,224,223	0.26%	0.26%
Letétkezelési díj	227,813	0.01%	0.01%
Felügyeleti díj	389,000	0.01%	0.01%
Könyvelési díj	274,999	0.01%	0.01%
Könyvvizsgálati díj	449,332	0.01%	0.01%
Forgalmazói díj	5,627,617	0.13%	0.13%
Tranzakciós költség	12,000	0.00%	0.00%
Befektetési alap különadója	555,000	0.01%	0.01%
Carrying cost	122,246	0.00%	0.00%
CFD Finance	2,822,836	0.07%	0.07%
Nettó eszközérték	4,286,311,133	99.50%	100.00%

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

„A” sorozat: 1,993,526,653 db

„B” sorozat EUR: 402,262 db

„C” sorozat USD: 2,673,924 db

D” sorozat: 1,404,868,096 db

III. Egy Befektetési jegyre eső Nettó eszközérték

„A” sorozat: 0.979790 HUF/db

„B” sorozat: 0.834147 EUR/db

„C” sorozat: 0.884968 USD/db

„D” sorozat: 0.995156 HUF/db

IV. Befektetési alap összetétele

Befektetési alap összetétele				
Megnevezés	Nyitó állomány (Ft)	NAV százalékában (%)	Záró állomány (Ft)	NAV százalékában (%)
Tőzsdén hivatalosan jegyzett értékpapírok	2,378,715,743	46.01%	2,537,574,112	59.21%
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	130,047,992	2.52%	201,723,287	4.71%
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	291,209,755	5.63%	299,882,138	7.00%
Származtatott pozíciók értéke	228,116,325	4.41%	781,213,736	18.23%
Nettó eszközérték	5,169,573,187	100.00%	4,286,065,294	100.00%

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

Budapest, 2023. 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.