



H O L D
A L A P K E Z E L Ő

HOLD VM ABSZOLÚT SZÁRMAZTATOTT
BEFEKTETÉSI ALAP

Féléves jelentés

2022.

FÉLÉVES JELENTÉS

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

I. Vagyongkimutatás

Adatok Ft-ban

2021.12.31	Piaci érték	Portfólió arányában	Nettó eszközérték arányában
Átruházható értékpapírok	1,769,351,130	29.52%	30.51%
MÁK 2022/B	44,265,176	0.74%	0.76%
D220309	4,083,342	0.07%	0.07%
D220406	167,066,224	2.79%	2.88%
D220629	125,350,557	2.09%	2.16%
D221228	125,832,795	2.10%	2.17%
US TREASURY BILL 2022/01/20	325,704,137	5.43%	5.62%
US TREASURY BILL 2022/02/10	325,707,069	5.43%	5.62%
US TREASURY BILL 2022/03/17	325,684,269	5.43%	5.62%
US TREASURY BILL 2022/04/14	325,657,561	5.43%	5.62%
Banki egyenlegek	2,029,155,334	33.86%	34.99%
EUR	341,968,019	5.71%	5.90%
HUF	1,638,146,541	27.33%	28.25%
USD	49,040,774	0.82%	0.85%
Követelések (ügyfélszámla)	2,039,977,593	34.04%	35.18%
EUR	479,778,442	8.00%	8.27%
USD	1,560,199,151	26.03%	26.90%
Egyéb eszközök	155,142,694	2.59%	2.68%
Összes eszköz	5,993,626,751	100.00%	103.35%
Kötelezettségek	194,526,091	3.25%	3.35%
Kötelezettségek értékpapír vásárlásból	167,066,224	2.79%	2.88%
Alapkezelési díj	19,443,876	0.32%	0.34%
Letétkezelési díj	268,879	0.00%	0.00%
Felügyeleti díj	521,000	0.01%	0.01%
Könyvelési díj	191,249	0.00%	0.00%
Könyvvizsgálati díj	200,000	0.00%	0.00%
Forgalmazói díj	5,867,153	0.10%	0.10%
Befektetési alap különadója	745,000	0.01%	0.01%
Tranzakciós díj	138,642	0.00%	0.00%
Carrying cost	84,068	0.00%	0.00%
Nettó eszközérték	5,799,100,660	96.75%	100.00%

Adatok Ft-ban

2022.06.30	Piaci érték	Portfólió arányában	Nettó eszközérték arányában
Átruházható értékpapírok	1,513,681,252	38.81%	39.00%
D221228	513,281	0.01%	0.01%
D230222	7,052,146	0.18%	0.18%
US TREASURY BILL 2022/10/06	378,215,067	9.70%	9.74%
US TREASURY BILL 2022/11/03	377,384,029	9.68%	9.72%
US TREASURY BILL 2022/12/01	376,449,253	9.65%	9.70%

US TREASURY BILL 2023/02/23	374,067,476	9.59%	9.64%
Banki egyenlegek	384,848,714	9.87%	9.92%
EUR	5,483,273	0.14%	0.14%
HUF	377,525,808	9.68%	9.73%
USD	1,839,633	0.05%	0.05%
Követelések (ügyfélszámla)	2,134,528,232	54.73%	55.00%
EUR	486,858,159	12.48%	12.54%
USD	1,647,670,073	42.25%	42.45%
Egyéb eszközök	-132,992,781	-3.41%	-3.43%
Összes eszköz	3,900,065,417	100.00%	100.49%
Kötelezettségek	18,869,792	0.48%	0.49%
Alapkezelési díj	12,353,103	0.32%	0.32%
Letétkezelési díj	177,289	0.00%	0.00%
Felügyeleti díj	352,000	0.01%	0.01%
Könyvelési díj	589,998	0.02%	0.02%
Könyvvizsgálati díj	200,000	0.01%	0.01%
Forgalmazói díj	4,551,883	0.12%	0.12%
Tranzakciós költség	142,519	0.00%	0.00%
Befektetési alap különadója	503,000	0.01%	0.01%
Nettó eszközérték	3,881,195,625	99.52%	100.00%

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

„A” sorozat 1,483,233,832 db

„B” sorozat 922,536,043 db

„C” sorozat 24,919,008 db

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

„A” sorozat 2.111275

„B” sorozat 0.957604

„C” sorozat 0.993900

IV. Befektetési alap összetétele

Befektetési Alap Összetétele				
Megnevezés	Nyitó állomány (HUF)	NAV százalékában (%)	Záró állomány (HUF)	NAV százalékában (%)
Tőzsdén hivatalosan jegyzett értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
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%	0	0.00%
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	1,769,351,130	30.51%	1,513,681,252	37.47%
Származtatott pozíciók értéke	-67,979,906	-1.17%	-147,271,842	-3.65%
Nettó eszközérték	5,799,405,471	100.00%	4,039,705,716	100.00%

Az Alap befektetési politikája módosult, RMAX helyett minimum hozamkorlátot (MHK) alkalmaz az alap a teljesítménymérésre.

Budapest, 2022. 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.