



HOLD Beat Származtatott Befektetési Alap

Féléves jelentés  
2023.

## FÉLÉVES JELENTÉS

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

## I. Vagyonkimutatás

Adatok Ft-ban

2022.12.31	Piaci érték	Portfolió arányában	Nettó eszközérték arányában
<b>Átruházható értékpapírok</b>	<b>1,088,571,165</b>	<b>81.07%</b>	<b>81.45%</b>
D231018	12,885,215	0.96%	0.96%
MFBEU2406/1	38,769,576	2.89%	2.90%
EXIM 2023/8	73,530,150	5.48%	5.50%
KERNEL HOLDING 6.5% 2024/10/17	34,432,650	2.56%	2.58%
MFBEU2310/1 KÖTVÉNY	91,429,668	6.81%	6.84%
MOL 2.625% 2023/04/28	60,927,496	4.54%	4.56%
MOLHB 1.5% 2027/10/08	59,286,966	4.42%	4.44%
OTPHB 2.875% 2029/07/15 CALL 240715	59,167,324	4.41%	4.43%
OTPHB 5.5% 2025/07/13	40,197,388	2.99%	3.01%
OTPHB FLOAT 2049/11/07	16,559,403	1.23%	1.24%
DEEP VALUE DRILLER ORD	19,244,385	1.43%	1.44%
DIGI	23,813,539	1.77%	1.78%
ISHARES BARCLAYS TIPS BOND	39,987,379	2.98%	2.99%
ISHARES MSCI POLAND INVESTABLE ETF	59,241,731	4.41%	4.43%
MPC CONTAINER SHIP	61,863,750	4.61%	4.63%
ORIGIN ENTERPRISES ORD	34,501,550	2.57%	2.58%
PKN ORLEN	49,345,956	3.67%	3.69%
POSTNL	34,031,256	2.53%	2.55%
PZU	30,230,970	2.25%	2.26%
VANECK VECTORS BITCOIN ETN	33,693,045	2.51%	2.52%
VANECK VECTORS ETHEREUM ETN	26,956,838	2.01%	2.02%
VANECK VECTORS GOLD MINERS ETF	32,300,966	2.41%	2.42%
VIENNA INSURANCE GROUP	35,782,350	2.66%	2.68%
ROMANIA 2.375% 2027/04/19	120,391,614	8.97%	9.01%
<b>Banki egyenlegek</b>	<b>94,426,117</b>	<b>7.03%</b>	<b>7.07%</b>
CAD	83,184	0.01%	0.02%
CHF	289,909	0.02%	0.04%
CZK	526,674	0.04%	4.12%
EUR	55,047,771	4.10%	0.00%
DKK	9,412	0.00%	1.85%
HUF	24,678,202	1.84%	0.54%
NOK	7,151,327	0.53%	0.54%
PLN	197,205	0.01%	0.01%
RON	36,541	0.00%	0.00%
USD	6,405,892	0.48%	0.48%

<b>Követelések (ügyfélszámla)</b>	<b>71,534,094</b>	<b>5.33%</b>	<b>5.35%</b>
EUR	39,030,895	2.91%	2.92%
USD	32,503,199	2.42%	2.43%
<b>Egyéb eszközök</b>	<b>88,227,090</b>	<b>6.57%</b>	<b>6.60%</b>
<b>Összes eszköz</b>	<b>1,342,758,466</b>	<b>100.00%</b>	<b>100.47%</b>
<b>Kötelezettségek</b>	<b>6,238,966</b>	<b>0.46%</b>	<b>0.47%</b>
Alapkezelési díj	4,901,126	0.37%	0.37%
Letétkezelési díj	73,505	0.01%	0.01%
Felügyeleti díj	114,000	0.01%	0.01%
Könyvelési díj	132,175	0.01%	0.01%
Könyvvizsgálati díj	597,371	0.04%	0.04%
Bizományosi díj	37,154	0.00%	0.00%
Bankköltség	11,571	0.00%	0.00%
Befektetési alap különadója	162,000	0.01%	0.01%
Tranzakciós díj	36,000	0.00%	0.00%
Borrowing cost	4,561	0.00%	0.00%
CFD Finance	98,441	0.01%	0.01%
Corporate Actions	-1,266	0.00%	0.00%
Deviza váltás eredménye	72,328	0.01%	0.01%
<b>Nettó eszközérték</b>	<b>1,336,519,500</b>	<b>99.54%</b>	<b>100.00%</b>

2023.06.30	Piaci érték	Portfólió arányában	Nettó eszközérték arányában
<b>Átruházható értékpapírok</b>	<b>1,141,840,083</b>	<b>72.09%</b>	<b>81.63%</b>
MFBEU2406/1	35,961,495	2.27%	2.57%
BANCA COMERCIALA 7.625% 2027/05/19	38,322,884	2.42%	2.74%
BANCA TRANSILVANIA 8.875% 2027/04/27	124,021,433	7.83%	8.87%
EXIM 2023/8	9,456,584	0.60%	0.68%
KERNEL HOLDING 6.5% 2024/10/17	51,727,121	3.27%	3.70%
MFBEU2310/1 KÖTVÉNY	64,340,314	4.06%	4.60%
MOLHB 1.5% 2027/10/08	58,563,861	3.70%	4.19%
OTPHB 2.875% 2029/07/15 CALL 240715	58,113,495	3.67%	4.15%
OTPHB FLOAT 2049/11/07	15,693,659	0.99%	1.12%
PEPCO 7.25% 2028/07/01	74,399,912	4.70%	5.32%
RAIFFEISEN 7.875% 2027/06/05 C260605	76,272,337	4.82%	5.45%
CAIRO MEZZ ORD	14,251,392	0.90%	1.02%
DEEP VALUE DRILLER ORD	18,215,670	1.15%	1.30%
DIGI	38,474,310	2.43%	2.75%
ENEA SA	31,996,743	2.02%	2.29%
ISHARES BARCLAYS TIPS BOND	36,849,088	2.33%	2.63%
ISHARES STOXX EUROPE 600 BANKS ETF	93,916,673	5.93%	6.71%
LYXOR MSCI GREECE	38,545,562	2.43%	2.76%
MO BRUK SA	27,318,564	1.72%	1.95%
NATL BANK OF GREECE SA	44,194,160	2.79%	3.16%
ORIGIN ENTERPRISES ORD	37,131,557	2.34%	2.65%
PZU	16,432,000	1.04%	1.17%
SPDR GOLD TRUST	30,519,824	1.93%	2.18%
VALARIS ORD	32,320,848	2.04%	2.31%

VANECK VECTORS BITCOIN ETN	11,076,746	0.70%	0.79%
VANECK VECTORS ETHEREUM ETN	7,550,269	0.48%	0.54%
VANECK VECTORS GOLD MINERS ETF	20,619,328	1.30%	1.47%
VIENNA INSURANCE GROUP	35,554,254	2.24%	2.54%
<b>Banki egyenlegek</b>	<b>145,103,912</b>	<b>9.16%</b>	<b>10.37%</b>
CAD	77,472	0.00%	0.01%
CHF	270,840	0.02%	0.02%
CZK	496,496	0.03%	0.04%
DKK	8,714	0.00%	0.00%
EUR	18,228,592	1.15%	1.30%
HUF	121,159,287	7.65%	8.66%
NOK	1,978,190	0.12%	0.14%
PLN	160,989	0.01%	0.01%
RON	80,055	0.01%	0.01%
USD	2,643,277	0.17%	0.19%
<b>Követelések (ügyfélszámla)</b>	<b>89,566,467</b>	<b>5.65%</b>	<b>6.40%</b>
EUR	34,490,280	2.18%	2.47%
USD	55,076,187	3.48%	3.94%
<b>Egyéb eszközök</b>	<b>207,344,978</b>	<b>13.09%</b>	<b>14.82%</b>
<b>Összes eszköz</b>	<b>1,583,855,440</b>	<b>100.00%</b>	<b>113.23%</b>
<b>Kötelezettségek</b>	<b>185,094,091</b>	<b>11.69%</b>	<b>13.23%</b>
Kötelezettségek értékpapír vásárlásból	178,821,428	11.29%	12.78%
Kötelezettségek bizományosi jutalékból	79,490	0.01%	0.01%
Alapkezelési díj	5,009,620	0.32%	0.36%
Letétkezelési díj	73,150	0.00%	0.01%
Felügyeleti díj	117,000	0.01%	0.01%
Könyvelési díj	75,000	0.00%	0.01%
Könyvvizsgálati díj	307,646	0.02%	0.02%
Kölcsönzési díj	404,757	0.03%	0.03%
Tranzakciós költség	39,000	0.00%	0.00%
Befektetési alap különadója	167,000	0.01%	0.01%
<b>Nettó eszközérték</b>	<b>1,398,761,349</b>	<b>88.31%</b>	<b>100.00%</b>

## II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

1,127,944,942 db

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

1.240221

## IV. Befektetési alap összetétele

Befektetési alap összetétele				
Megnevezés	Nyitó állomány (Ft)	NAV százalékában (%)	Záró állomány (Ft)	NAV százalékában (%)
Tőzsdén hivatalosan jegyzett értékpapírok	790,071,215	59.11%	910,312,862	65.07%
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	165,223,121	12.36%	231,527,221	16.55%
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	133,276,829	9.97%	0	0.00%
Származtatott pozíciók értéke	87,322,356	6.53%	178,848,155	12.78%
Nettó eszközérték	1,336,555,000	100.00%	1,398,900,612	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.