



# Palomar Származtatott Befektetési Alap

Féléves jelentés  
2023.

## FÉLÉVES JELENTÉS

A Palomar Származtatott Befektetési Alap 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
<b>Átruházható értékpapírok</b>	<b>845,570,556</b>	<b>30.54%</b>	<b>38.84%</b>
FRANCE TREASURY BILL 2023/03/01	319,377,086	11.54%	14.67%
MFBEU2310/1 KÖTVÉNY	159,008,118	5.74%	7.30%
MOL 2.625% 2023/04/28	162,473,322	5.87%	7.46%
OTPHB 7.35% 2026/03/04 CALL 25/03/04	204,712,030	7.39%	9.40%
<b>Banki egyenlegek</b>	<b>1,687,381,577</b>	<b>60.95%</b>	<b>77.50%</b>
EUR	1,510,825,672	54.57%	69.39%
HUF	176,382,780	6.37%	8.10%
USD	173,125	0.01%	0.01%
<b>Követelések (ügyfélszámla)</b>	<b>109,641,586</b>	<b>3.96%</b>	<b>5.04%</b>
EUR	110,364,263	3.99%	5.07%
USD	-722,677	-0.03%	-0.03%
<b>Egyéb eszközök</b>	<b>126,020,089</b>	<b>4.55%</b>	<b>5.79%</b>
<b>Összes eszköz</b>	<b>2,768,613,808</b>	<b>100.00%</b>	<b>127.16%</b>
<b>Kötelezettségek</b>	<b>591,381,259</b>	<b>21.36%</b>	<b>27.16%</b>
Kötelezettségek értékpapír kölcsönből	577,048,300	20.84%	26.50%
Alapkezelési díj	4,990,206	0.18%	0.23%
Sikerdíj	8,428,658	0.30%	0.39%
Letétkezelési díj	111,883	0.00%	0.01%
Felügyeleti díj	163,000	0.01%	0.01%
Könyvelési díj	202,599	0.01%	0.01%
Könyvvizsgálati díj	174,095	0.01%	0.01%
Forgalmazói díj	0	0.00%	0.00%
Befektetési alap különadója	232,000	0.01%	0.01%
Tranzakciós díj	8,000	0.00%	0.00%
Carrying cost	22,518	0.00%	0.00%
CFD Finance	0	0.00%	0.00%
Corporate Actions	0	0.00%	0.00%
Borrowing cost	0	0.00%	0.00%
<b>Nettó eszközérték</b>	<b>2,177,232,549</b>	<b>78.64%</b>	<b>100.00%</b>

2023.06.30	Piaci érték	Portfólió arányában	Nettó eszközérték arányában
<b>Átruházható értékpapírok</b>	<b>2,097,539,455</b>	<b>64.01%</b>	<b>92.76%</b>
FRANCE TREASURY BILL 2023/07/19	444,781,491	13.57%	19.67%
FRANCE TREASURY BILL 2023/07/26	444,518,731	13.56%	19.66%
BANCA COMERCIALA 7.625% 2027/05/19	38,322,884	1.17%	1.69%
BANCA TRANSILVANIA 8.875% 2027/04/27	153,088,956	4.67%	6.77%
MFBEU2310/1 KÖTVÉNY	186,586,911	5.69%	8.25%
NOVA KREDITNA BANK 7.375 26/06/29 C25	149,720,077	4.57%	6.62%

RAIFFEISEN 7.125% 2026/01/19 C250119	76,394,364	2.33%	3.38%
RAIFFEISEN 7.875% 2027/06/05 C260605	190,680,841	5.82%	8.43%
MÁK 2023/B	413,445,200	12.62%	18.28%
<b>Banki egyenlegek</b>	<b>821,733,808</b>	<b>25.08%</b>	<b>36.34%</b>
EUR	789,811,581	24.10%	34.93%
HUF	31,486,715	0.96%	1.39%
USD	435,512	0.01%	0.02%
<b>Követelések (ügyszámla)</b>	<b>144,880,186</b>	<b>4.42%</b>	<b>6.41%</b>
EUR	145,157,976	4.43%	6.42%
USD	-277,790	-0.01%	-0.01%
<b>Egyéb eszközök</b>	<b>212,915,007</b>	<b>6.50%</b>	<b>9.42%</b>
<b>Összes eszköz</b>	<b>3,277,068,456</b>	<b>100.00%</b>	<b>144.92%</b>
<b>Kötelezettségek</b>	<b>1,015,775,024</b>	<b>31.00%</b>	<b>44.92%</b>
Kötelezettségek értékpapír vásárlásból	74,800,173	2.28%	3.31%
Kötelezettségek értékpapír kölcsönadásból	922,121,500	28.14%	40.78%
Kölcsönzési díj	2,216,426	0.07%	0.10%
Kamat követelés kötelezettség	9,116,417	0.28%	0.40%
Alapkezelési díj	6,370,659	0.19%	0.28%
Letétkezelési díj	118,222	0.00%	0.01%
Felügyeleti díj	192,000	0.01%	0.01%
Könyvelési díj	125,000	0.00%	0.01%
Könyvvizsgálati díj	342,900	0.01%	0.02%
Tranzakciós költség	12,000	0.00%	0.00%
Befektetési alap különadója	275,000	0.01%	0.01%
Carrying cost	52,254	0.00%	0.00%
FX nyitás költsége	32,473	0.00%	0.00%
<b>Nettó eszközérték</b>	<b>2,261,293,432</b>	<b>69.00%</b>	<b>100.00%</b>

## II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

„A” sorozat: 377,484,732 db

„B” sorozat EUR: 109,515 db

„C” sorozat USD: 100,880 db

D” sorozat: 1,643,017,938 db

## III. Egy Befektetési jegyre eső Nettó eszközérték

„A” sorozat: 1.039260 HUF/db

„B” sorozat: 0.941041 EUR/db

„C” sorozat: 0.966504 USD/db

„D” sorozat: 1.055475 HUF/db

## IV. Befektetési alap összetétele

Befektetési alap összetétele				
Megnevezés	Nyitó állomány (Ft)	NAV százalékában (%)	Záró állomány (Ft)	NAV százalékában (%)
Tőzsdén hivatalosan jegyzett értékpapírok	526,193,470	24.17%	794,794,033	36.16%
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	-257,324,214	-11.82%	328,156,422	14.93%
Származtatott pozíciók értéke	121,505,239	5.58%	79,567,526	3.62%
Nettó eszközérték	2,177,241,156	100.00%	2,198,101,412	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.