Palomar Származtatott Befektetési Alap

Féléves jelentés

2024.

FÉLÉVES JELENTÉS

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

I. Vagyonkimutatás

Adatok Ft-ban

2023.12.31	Piaci érték	Portfolió arányában	Nettó eszközérték arányában
Átruházható értékpapírok	**1,990,826,663**	**77.89%**	**78.78%**
FRANCE TREASURY BILL 2024/01/17	573,371,904	22.43%	22.69%
FRANCE TREASURY BILL 2024/01/24	229,201,774	8.97%	9.07%
FRANCE TREASURY BILL 2024/01/31	534,402,220	20.91%	21.15%
BANCA COMERCIALA 7.625% 2027/05/19	42,267,448	1.65%	1.67%
BANCA TRANSILVANIA 7.25% 2028/12/07	67,357,559	2.64%	2.67%
BANCA TRANSILVANIA 8.875% 2027/04/27	168,732,090	6.60%	6.68%
NOVA KREDITNA BANK 7.375 26/06/29 C25	164,111,260	6.42%	6.49%
RAIFFEISEN 7.875% 2027/06/05 C260605	211,382,408	8.27%	8.37%
Banki egyenlegek	**154,156,815**	**6.03%**	**6.10%**
EUR	76,867,820	3.01%	3.04%
HUF	23,300,537	0.91%	0.92%
USD	53,988,458	2.11%	2.14%
Követelések (ügyfélszámla)	**333,713,717**	**13.06%**	**13.21%**
EUR	180,195,763	7.05%	7.13%
USD	153,517,954	6.01%	6.08%
Egyéb eszközök	**77,278,331**	**3.02%**	**3.06%**
Összes eszköz	**2,555,975,526**	**100.00%**	**101.15%**
Kötelezettségek	**29,013,249**	**1.14%**	**1.15%**
Alapkezelési díj	7,380,196	0.29%	0.29%
Sikerdíj	19,900,094	0.78%	0.79%
Letétkezelési díj	138,018	0.01%	0.01%
Felügyeleti díj	218,000	0.01%	0.01%
Könyvelési díj	125,000	0.00%	0.00%
Könyvvizsgálati díj	685,800	0.03%	0.03%
Befektetési alap különadója	312,000	0.01%	0.01%
Tranzakciós díj	4,000	0.00%	0.00%
Carrying cost	73,875	0.00%	0.00%
Határidős jutalék	176,266	0.01%	0.01%
Nettó eszközérték	**2,526,962,277**	**98.86%**	**100.00%**

Adatok Ft-ban

2024.06.30	Piaci érték	Portfolió arányában	Nettó eszközérték arányában
Átruházható értékpapírok	**678,203,704**	**24.18%**	**24.56%**
BANCA TRANSILVANIA 7.25% 2028/12/07	72,732,257	2.59%	2.63%
BANCA TRANSILVANIA 8.875% 2027/04/27	82,560,161	2.94%	2.99%
ERSTE&STEIERMAR BANK 4.875% 2029/01/31 CALL 2028/01/31	81,983,035	2.92%	2.97%
MNB240704	269,720,820	9.61%	9.77%
NOVA KREDITNA BANK 7.375 26/06/29 C25	86,901,230	3.10%	3.15%
RAIFFEISEN 7.875% 2027/06/05 C260605	84,306,201	3.01%	3.05%

Banki egyenlegek	**1,776,464,923**	**63.33%**	**64.34%**
EUR	843,841,122	30.08%	30.56%
HUF	931,397,977	33.20%	33.73%
USD	1,225,824	0.04%	0.04%
Követelések (ügyfélszámla)	**370,274,114**	**13.20%**	**13.41%**
EUR	182,596,725	6.51%	6.61%
USD	187,677,389	6.69%	6.80%
Egyéb eszközök	**-19,632,028**	**-0.70%**	**-0.71%**
Összes eszköz	**2,805,310,713**	**100.00%**	**101.61%**
Kötelezettségek	**44,366,683**	**1.58%**	**1.61%**
Alapkezelési díj	8,085,817	0.29%	0.29%
Sikerdíj	34,709,340	1.24%	1.26%
Letétkezelési díj	148,957	0.01%	0.01%
Felügyeleti díj	249,000	0.01%	0.01%
Könyvelési díj	250,000	0.01%	0.01%
Könyvvizsgálati díj	403,225	0.01%	0.01%
Tranzakciós költség	4,000	0.00%	0.00%
Befektetési alap különadója	350,000	0.01%	0.01%
Carrying cost	46,949	0.00%	0.00%
FX nyitás költsége	119,395	0.00%	0.00%
Nettó eszközérték	**2,760,944,030**	**98.42%**	**100.00%**

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

„A" sorozat: 379,383,037 db

„B" sorozat EUR: 100,000 db

„C" sorozat USD: 114,227 db

D" sorozat: 1,554,195,241 db

III. Egy Befektetési jegyre eső Nettó eszközérték

„A" sorozat: 1.336700 HUF/db

„B" sorozat: 1.149529 EUR/db

„C" sorozat: 1.192566 USD/db

„D" sorozat: 1.388648 HUF/db

IV. Befektetési alap összetétele

Befektetési alap összetétele				
Megnevezés	Nyitó állomány (Ft)	NEÉ százalékában (%)	Záró állomány (Ft)	NEÉ százalékában (%)
Tőzsdén hivatalosan jegyzett értékpapírok	586,493,206	23.21%	335,750,627	12.16%
más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	67357559	2.67%	72732257	2.63%
egyéb átruházható értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	1,336,975,898	52.91%	269,720,820	9.77%
Származtatott pozíciók értéke	75,053,247	2.97%	-26,976,626	-0.98%
Nettó eszközérték (NEÉ)	2,526,956,898	100.00%	2,761,095,922	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.