

privátvagyonkezelés

©|CONCORDE ALAPKEZELŐ

CONCORDE PB2 ALAPOK ALAPJA

Féléves jelentés

2015.

A Concorde PB2 Alapok Alapja Féléves jelentése a 2014. évi XVI. törvény 6. számú melléklete alapján készült.

I. Vagyonkimutatás

Vagyonkimutatás										
	Tárgynap (T):	2014.12.31					2015.06.30			
I.	KÖTELEZETTSÉGEK		Összeg/Érték	Devizanem	(%)	KÖTELEZETTSÉGEK		Összeg/Érték	Devizanem	(%)
I/1.	Hitelállomány (összes):		0	Ft		Hitelállomány (összes):		0	Ft	
I/2.	Egyéb kötelezettségek (összes):		259,032,995	Ft	99.59%	Egyéb kötelezettségek (összes):		29,878,268	Ft	98.16%
	Letétkezelői díj miatt			Ft		Letétkezelői díj miatt		409,309	Ft	1.34%
	Bizományosi díj miatt			Ft		Bizományosi díj miatt		27,055	Ft	0.09%
	Forgalmazói költség miatt			Ft		Forgalmazói költség miatt			Ft	
	Közzétételi költség miatt			Ft		Közzétételi költség miatt			Ft	
	Különadó miatt			Ft		Különadó miatt		266,769	Ft	0.88%
	Forgalomban tartási díj miatt			Ft		Forgalomban tartási díj miatt		308,138	Ft	1.01%
	Sikerdíj miatt			Ft		Sikerdíj miatt			Ft	
	Költségként elszámolt egyéb tétel (Felügyeleti díj)		679,000	Ft	0.26%	Költségként elszámolt egyéb tétel (Felügyeleti díj)		774,000	Ft	2.54%
	Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség		258,353,995	Ft	99.33%	Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség		28,092,997	Ft	92.29%
I/3.	Céltartalékok (összes):		0	Ft		Céltartalékok (összes):		0	Ft	
I/4.	Passzív időbeli elhatárolások (összes):		1,064,042	Ft	0.41%	Passzív időbeli elhatárolások (összes):		561,083	Ft	1.84%
	Könyvvizsgálat		208,164	Ft	0.08%	Könyvvizsgálat		214,409	Ft	0.70%
	Könyvelés		165,083	Ft	0.06%	Könyvelés		346,674	Ft	1.14%
	Hirdetési díj		0	Ft		Hirdetési díj		0	Ft	
	Bankköltség		0	Ft		Bankköltség		0	Ft	
	Transzfer érkeztetett ép bek.ért. elhatárolása		0	Ft		Transzfer érkeztetett ép bek.ért. elhatárolása		0	Ft	
	Bizományosi jutalék		28,600	Ft	0.01%	Bizományosi jutalék			Ft	
	Forgalmazási jutalék		267,953	Ft	0.10%	Forgalmazási jutalék			Ft	
	Letétkezelési díj		394,242	Ft	0.15%	Letétkezelési díj			Ft	
	Kötelezettségek összesen:		260,097,037	Ft	100.00%	Kötelezettségek összesen:		30,439,351	Ft	100.00%
II.	ESZKÖZÖK		Összeg/Érték	Devizanem	(%)	ESZKÖZÖK		Összeg/Érték	Devizanem	(%)
II/1.	Folyószámla, készpénz (összes):		732,298	Ft	0.01%	Folyószámla, készpénz (összes):		731,447	Ft	0.01%
	Elszámolási betétszámla HUF		157,460	Ft	0.00%	Elszámolási betétszámla HUF		136,721	Ft	0.00%
	Devizabetétszámla - USD		245,520	Ft	0.00%	Devizabetétszámla - USD		265,941	Ft	0.00%
	Devizabetétszámla - EUR		329,318	Ft	0.00%	Devizabetétszámla - EUR		328,785	Ft	0.00%
	Valuta, deviza betétek értékelési		0	Ft		Valuta, deviza betétek értékelési		0	Ft	

CONCORDE PB2 ALAPOK ALAPJA

Féléves jelentés (2015)

	különbözete					különbözete				
	USD bank értékkülönbözete			Ft		USD bank értékkülönbözete		0	Ft	
	EUR bank értékkülönbözete			Ft		EUR bank értékkülönbözete		0	Ft	
II/2.	Egyéb követelés (összes):		692,758,000	Ft	5.73%	Egyéb követelés (összes):		13,261,594	Ft	0.11%
	Concorde Rt ügyfélszámla		0	Ft		Concorde Rt ügyfélszámla		7,861	Ft	0.00%
	Devizapénzszámla- USD		0	Ft		Devizapénzszámla- USD		0	Ft	
	Devizapénzszámla- EUR		692,758,000	Ft	5.73%	Devizapénzszámla- EUR		0	Ft	
	Követelések értékpapír eladásból		0	Ft		Követelések értékpapír eladásból		13,253,733	Ft	0.11%
II/2.1.	Származtatott ügyletek értékelési különb		-5,061,069	Ft	-0.04%	Származtatott ügyletek értékelési különb		-9,177,939	Ft	-0.07%
II/3.	Lekötött bankbetétek (összes):		0	Ft		Lekötött bankbetétek (összes):		0	Ft	
II/3.1.	Max. 3 hó lekötésű (összes):		0	Ft		Max. 3 hó lekötésű (összes):		0	Ft	
II/3.2.	3 hónapnál hosszabb lekötésű (összes):		0	Ft		3 hónapnál hosszabb lekötésű (összes):		0	Ft	
		Darabszám	Összeg/Érték	Devi zan em	(%)		Darabszám	Összeg/Érték	Devi zan em	(%)
II/4.	Értékpapírok (összes):	6,238,093, 201	11,395,285,5 40	Ft	94.30%	Értékpapírok (összes):	6,076,728, 103	12,460,537,5 77	Ft	99.96%
II/4.1.	Állampapírok (összes):	998,022,1 66	1,360,401,40 4	Ft	11.26%	Állampapírok (összes):	992,223,3 60	1,334,339,45 4	Ft	10.70%
II/4.1.1.	Kötvények (összes):	997,997,9 31	1,118,775,72 1	Ft	9.26%	Kötvények (összes):	992,197,9 31	1,080,266,69 3	Ft	8.67%
	MÁK 2020/N	850,000,0 00	955,982,250	Ft	7.91%	MÁK 2020/N	844,200,0 00	913,538,367	Ft	7.33%
	MÁK 2020/O	1,270,000	1,413,582	Ft	0.01%	MÁK 2020/O	1,270,000	1,374,311	Ft	0.01%
	MÁK 2020/P	146,727,9 31	161,379,889	Ft	1.34%	MÁK 2020/P	146,727,9 31	165,354,015	Ft	1.33%
II/4.1.2.	Kincstárjegyek (összes):	24,235	241,625,683	Ft	2.00%	Kincstárjegyek (összes):	25,429	254,072,761	Ft	2.04%
	D150121	4,560	45,562,015	Ft	0.38%	D150701	4,323	43,228,790	Ft	0.35%
	D150204	1,010	10,085,981	Ft	0.08%	D150708	5,329	53,278,063	Ft	0.43%
	D150401	18,665	185,977,687	Ft	1.54%	D150722	4,252	42,493,765	Ft	0.34%
						D150812	8,153	81,431,756		0.65%
				Ft		D150909	2,124	21,197,775	Ft	0.17%
				Ft		D150923	1,111	11,083,569	Ft	0.09%
				Ft		D160413	137	1,359,043	Ft	0.01%
II/4.1.3.	Egyéb jegybankképes ép. (összes):	0	0	Ft		Egyéb jegybankképes ép. (összes):	0	0	Ft	
II/4.1.4.	Külföldi állampapírok (összes):	0	0	Ft		Külföldi állampapírok (összes):	0	0	Ft	
II/4.2.	Gazdálkodói és egyéb hitelviszonyt megtestesítő	0	0	Ft		Gazdálkodói és egyéb hitelviszonyt megtestesítő	0	0	Ft	
II/4.2.1.	Tőzsdére bevezetett (összes):	0	0	Ft		Tőzsdére bevezetett (összes):	0	0	Ft	
II/4.2.2.	Külföldi kötvények (összes):	0	0	Ft		Külföldi kötvények (összes):	0	0	Ft	
II/4.2.3.	Tőzsdén kívüli (összes):	0	0	Ft		Tőzsdén kívüli (összes):	0	0	Ft	
II/4.3.	Részvények (összes):	16,051	50,193,422	Ft	0.42%	Részvények (összes):	16,051	61,840,050	Ft	0.50%
II/4.3.1.	Tőzsdére bevezetett (összes):	0	0	Ft		Tőzsdére bevezetett (összes):	0	0	Ft	
II/4.3.2.	Külföldi részvények (összes):	16,051	50,193,422	Ft	0.42%	Külföldi részvények (összes):	16,051	61,840,050	Ft	0.50%
	TOPIX ETF 1306	16,051	50,193,422	Ft	0.42%	TOPIX ETF 1306	16,051	61,840,050	Ft	0.50%
II/4.3.3.	Tőzsdén kívüli (összes):	0	0	Ft		Tőzsdén kívüli (összes):	0	0	Ft	

II/4.4.	Jelzáloglevelek (összes):	0	0	Ft		Jelzáloglevelek (összes):	0	0	Ft	
II/4.4.1.	Tőzsdére bevezetett (összes):	0	0	Ft		Tőzsdére bevezetett (összes):	0	0	Ft	
II/4.4.2.	Tőzsdén kívüli (összes):	0	0	Ft		Tőzsdén kívüli (összes):	0	0	Ft	
II/4.5.	Befektetési jegyek (összes):	5,240,054,984	9,984,690,714	Ft	82.63%	Befektetési jegyek (összes):	5,084,488,692	11,064,358,073	Ft	88.76%
II/4.5.1.	Tőzsdére bevezetett (összes):	5,182,766,633	9,957,104,540	Ft	82.40%	Tőzsdére bevezetett (összes):	5,027,200,341	11,034,663,000	Ft	88.52%
	CITADELLA SZÁRM.BEF.ALAP	2,320,778,279	3,841,187,432	Ft	31.79%	CITADELLA SZÁRM.BEF.ALAP	2,004,884,808	3,763,627,903	Ft	30.19%
				Ft		CONCORDE COLUMBUS CLASS B1 - EUR	255	895,414,499	Ft	7.18%
						CONCORDE RUBICON SZÁRM.ALAP	51,904,822	181,251,794	Ft	1.45%
	CONCORDE-VM	2,825,331,981	6,115,577,990			CONCORDE-VM ALAP	2,933,754,083	6,194,131,809	Ft	49.69%
	MAG ING.BEF.ALAP ZV	36,655,677	0	Ft		MAG ING.BEF.ALAP ZV	36,655,677	0	Ft	
	NAP ING.FEJL.ALAP A - LEJÁRT	625	303,900	Ft	0.00%	NAP ING.FEJL.ALAP A - LEJÁRT	625	212,383	Ft	0.00%
	NAP ING.FEJL.BEF.ALAP B - LEJÁRT	71	35,218	Ft	0.00%	NAP ING.FEJL.BEF.ALAP B - LEJÁRT	71	24,612	Ft	0.00%
II/4.5.2.	Tőzsdén kívüli (összes):	57,288,351	27,586,174	Ft	0.23%	Tőzsdén kívüli (összes):	57,288,351	29,695,073	Ft	0.24%
	CARION ING.BEF.ALAP	57,288,351	27,586,174	Ft	0.23%	CARION ING.BEF.ALAP	57,288,351	29,695,073	Ft	0.24%
II/4.6.	Kárpótlási jegy (összes):	0	0	Ft		Kárpótlási jegy (összes):	0	0	Ft	
II/5.	Aktív időbeli elhatárolások (összes):	0	0	Ft		Aktív időbeli elhatárolások (összes):	0	0	Ft	
	ESZKÖZÖK ÖSSZESEN:	6,238,093,201	12,083,714,769	Ft	100.00%	ESZKÖZÖK ÖSSZESEN:	6,076,728,103	12,465,352,679	Ft	100.00%

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

7,064,672,410 db

III. Egy Befektetési jegyre eső Nettó eszközérték

1.760159

IV. Befektetési alap összetétele

Befektetési Alap Összetétele				
Megnevezés	Nyitó állomány	NAV százalékában (%)	Záró állomány	NAV százalékában (%)
Tőzsdén hivatalosan jegyzett értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	1,360,401,404	11.51%	1,334,339,454	10.73%
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb átruházható értékpapírok	10,034,884,136	84.87%	11,126,198,123	89.48%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
Származtatott pozíciók értéke	-5,061,070	-0.04%	-9,177,939	-0.07%

Nettó eszközérték	11,823,629,245	100.00%	12,434,948,469	100.00%
-------------------	----------------	---------	----------------	---------

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

Kiegészítő információk

V. Az ABAK – ide nem értve a 2. § (2) bekezdés szerinti ABAK-ot – által az adott időszakra kifizetett javadalmazás teljes összege az ABAK alkalmazottainak kifizetett rögzített és változó javadalmazás szerinti bontásban, a kedvezményezettek száma és a kifizetett nyereségrészesedés, valamint a javadalmazás teljes összege az ABAK ügyvezetői és azon munkavállalói szerinti bontásban, akik az ABA kockázati profiljára tevékenységük révén lényeges hatást gyakorolnak

Az ABAK a javadalmazási politikája alapján, az ABA teljesítményéhez köthető változó javadalmazás jogcímen kifizetést nem eszközölt. Az ABAK alkalmazottainak kifizetett rögzített javadalmazás összege a 2014. évben ~ 250 millió Ft volt, ennek 30%-a került kifizetésre azon munkavállalók részére, akik az ABA kockázati profiljára tevékenységük révén lényeges hatást gyakorolnak.

VI. Az ABAK – ide nem értve a 2. § (2) bekezdés szerinti ABAK-ot – által kezelt minden uniós ABA és minden, általa az EGT-államokban forgalmazott ABA tekintetében

Az ABAK-ból javadalmazási kifizetés nem történt.

a) az ABA olyan eszközeinek aránya, amelyekre nem likvid jellegüknél fogva különleges szabályok vonatkoznak

Nincs az Alapban olyan eszköz, amelynek likviditása miatt külön szabályozásra került volna sor.

b) az ABA likviditáskezelésével kapcsolatos minden, az adott időszakban kötött új megállapodás

Nincs az Alapban olyan eszköz, amelynek likviditása miatt külön szabályozásra került volna sor.

c) az ABA aktuális kockázati profilja és az ABAK által e kockázatok kezelése érdekében alkalmazott kockázatkezelési rendszerek

Az Alap szintetikus hozam/kockázati mutatója: 3.

Az Alapkezelő Kockázatkezelési Szabályzata alapján az alapkezelő által kezelt befektetési alapok kockázati mutatójaként a szintetikus hozam/kockázati mutató szolgál. A szintetikus hozam/kockázati mutató (Synthetic Risk Reward Indicator=SRRI) számításához az Alap elmúlt 5 évbeli heti hozamadatai szolgálnak alapul, így annak értéke minden évben változhat, mely így nem szükségszerűen megbízható mutatója az Alap jövőbeni kockázati profiljának. Ahol az Alapra nem állnak rendelkezésre az elmúlt teljes 5 évre hozam adatok, akkor az Alap által elfogadott kockázati limitek alapján számított évesített volatilitást használtuk. A skálán a legalacsonyabb (1-es) szint sem jelent kockázatmentes befektetést.

VII. A tőkeáttételt alkalmazó uniós ABA-t kezelő, vagy a tőkeáttételt alkalmazó ABA-t az EGT-államokban forgalmazó ABAK által az ABA nevében alkalmazható tőkeáttétel mértékében bekövetkező változások, valamint a biztosíték vagy a tőkeáttételi megállapodás

értelmében nyújtott garanciák újbóli felhasználási joga, és az adott ABA által alkalmazott tőkeáttétel teljes összege

Alap neve	Dátum	Nettó összesített kockázati kitétség (tőkeáttétel) mértéke (%)
CONCORDE PB2 ALAPOK ALAPJA	2015.01.30	106
CONCORDE PB2 ALAPOK ALAPJA	2015.02.27	105
CONCORDE PB2 ALAPOK ALAPJA	2015.03.31	106
CONCORDE PB2 ALAPOK ALAPJA	2015.04.30	107
CONCORDE PB2 ALAPOK ALAPJA	2015.05.29	105
CONCORDE PB2 ALAPOK ALAPJA	2015.06.30	107

A Fenti táblázat mutatja az ABA által alkalmazott tőkeáttétel mértékének változását a 2015. első féléves hó végi állapota alapján.

Az Alap Kezelési szabályzata alapján, az alap által felvehető maximális mértékű tőkeáttétel mértéke maximum 200%.

Az ABAK nem kötött biztosíték és tőkeáttételi garancia megállapodást, a tőkeáttétel fedezetére az alapon lévő rövid lejáratú likvid állampapírok szolgálnak.

Budapest, 2015. augusztus 13.

Hrehovszki Hedvig

Folyamatszervezési és termék menedzsment Igazgató
Concorde Alapkezelő zrt.

Mérész András

Folyamatszervező
Concorde 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.