

CONCORDE
A ALAPKEZELŐ

CONCORDE KOGA ALAPOK ALAPJA

Féléves jelentés

2016.

FÉLÉVES JELENTÉS

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

I. Vagyonkimutatás

	2015.12.31			2016.06.30		
	Piaci érték	Portfolió arányában	Nettó eszközérték arányában	Piaci érték	Portfolió arányában	Nettó eszközérték arányában
Átruházható értékpapírok	917,476,702	99.98%	100.07%	931,354,580	99.99%	100.28%
Citadella Származtatott Befektetési Alap	151,074,260	16.46%	16.48%	158,260,222	16.99%	17.04%
Concorde Columbus Befektetési Alap	187,632,816	20.45%	20.46%	193,114,423	20.73%	20.79%
Concorde Rövid Kötvény Befektetési Alap	48,957,742	5.34%	5.34%	49,488,367	5.31%	5.33%
Concorde VM Abszolút Származtatott Alap	255,203,358	27.81%	27.83%	249,184,929	26.75%	26.83%
D160120	2,069,081	0.23%	0.23%	0	0.00%	0.00%
D160413	2,195,171	0.24%	0.24%	0	0.00%	0.00%
D160727	0	0.00%	0.00%	3,367,853	0.36%	0.36%
Platina Pí Származtatott Befektetési Alap "A sorozat"	270,344,274	29.46%	29.49%	277,938,786	29.84%	29.93%
Banki egyenlegek	167,875	0.02%	0.02%	93,058	0.01%	0.01%
HUF	167,875	0.02%	0.02%	93,058	0.01%	0.01%
Követelések (ügyfélszámla)	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Egyéb eszközök	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Összes eszköz	917,644,577	100.00%	100.09%	931,447,638	100.00%	100.29%
Kötelezettségek	779,703	0.08%	0.09%	2,664,311	0.29%	0.29%
Kötelezettségek értékpapír vásárlásból	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Kötelezettségek bizományosi jutalékból	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Kötelezettségek befektetési jegy visszaváltásból	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Alapkezelési díj	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Sikerdíj	0	0.00%	0.00%	1,948,385	0.21%	0.21%
Letétkezelési díj	58,475	0.01%	0.01%	57,062	0.01%	0.01%
Felügyeleti díj	57,000	0.01%	0.01%	58,000	0.01%	0.01%
Könyvelési díj	173,337	0.02%	0.02%	346,674	0.04%	0.04%
Könyvvizsgálati díj	485,717	0.05%	0.05%	250,144	0.03%	0.03%
Bizományosi díj	4,800	0.00%	0.00%	4,000	0.00%	0.00%
Forgalmazói díj	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Befektetési alap különadója	374	0.00%	0.00%	46	0.00%	0.00%
Nettó eszközérték	916,864,874	99.92%	100.00%	928,783,327	99.71%	100.00%

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

859,505,798 db

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

1.080238

IV. Befektetési alap összetétele

Befektetési Alap Összetétele				
Megnevezés	Nyitó állomány (e Ft)	NAV százalékában (%)	Záró állomány (e Ft)	NAV százalékában (%)
Tőzsdén hivatalosan jegyzett értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	4,264,252	0.47%	4,264,252	0.46%
a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
egyéb átruházható értékpapírok	913,212,450	99.62%	913,212,450	98.36%
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
Származtatott pozíciók értéke	0	0.00%	0	0.00%
Nettó eszközérték	916,692,731	100.00%	928,470,892	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 ~ 220 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: 2.

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 évbéli 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 Koga Alapok Alapja	2016.01.29	100
Concorde Koga Alapok Alapja	2016.02.29	100
Concorde Koga Alapok Alapja	2016.03.31	100
Concorde Koga Alapok Alapja	2016.04.29	100
Concorde Koga Alapok Alapja	2016.05.31	100
Concorde Koga Alapok Alapja	2016.06.30	100

A fenti táblázat mutatja az ABA által alkalmazott tőkeáttétel mértékének változását a 2016. június 30-i 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, 2016. augusztus 10.

Móricz Dániel

Befektetési 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.