

CONCORDE
ALAPKEZELŐ

CONCORDE USD PB3 ALAPOK ALAPJA

Féléves jelentés

2016.

FÉLÉVES JELENTÉS

A Concorde USD PB3 Alapok Alapja Féléves jelentése a 2014. évi XVI. törvény 6. számú melléklete alapján készült.

I. Vagyongkimutató

	2015.12.31			2016.06.30		
	Piaci érték	Portfolió arányában	Nettó eszközérték arányában	Piaci érték	Portfolió arányában	Nettó eszközérték arányában
Átruházható értékpapírok	3,910,587,531	98.98%	99.72%	3,902,862,893	93.96%	95.31%
Concorde 2016 DEV Vállalati KTV Származtatott Bef. Alap	6,381,613	0.16%	0.16%	35,763,543	0.86%	0.87%
Concorde COL OPP Offshore 15/01	15,142,858	0.38%	0.39%	15,013,548	0.36%	0.37%
Concorde COL OPP Offshore 15/02	15,592,117	0.39%	0.40%	15,458,857	0.37%	0.38%
Concorde COL OPP Offshore 15/07	22,289,334	0.56%	0.57%	22,136,701	0.53%	0.54%
Concorde Columbus Befektetési Alap	1,230,686,786	31.15%	31.38%	1,216,610,319	29.29%	29.71%
Concorde Hozamkereső Európai Származtatott Részvény Befektetési Alap	17,575,886	0.44%	0.45%	175,610,763	4.23%	4.29%
Concorde Közép-európai Részvény Alap	259,650,420	6.57%	6.62%	259,134,850	6.24%	6.33%
Concorde Nemzetközi Részvény Alapok Alapja	385,795,043	9.76%	9.84%	236,686,211	5.70%	5.78%
Concorde PI Alternative Inv 15/01	15,991,057	0.40%	0.41%	0	0.00%	0.00%
Concorde PI Alternative Inv 15/02	16,386,995	0.41%	0.42%	0	0.00%	0.00%
Concorde PI Alternative Inv 15/07	67,272,318	1.70%	1.72%	0	0.00%	0.00%
Concorde PI Alternative Inv Fund	0	0.00%	0.00%	99,910,158	2.41%	2.44%
Concorde Részvény Befektetési Alap	424,957,055	10.76%	10.84%	464,126,615	11.17%	11.33%
Concorde Rövid Kötvény Befektetési Alap	183,646,602	4.65%	4.68%	161,378,387	3.88%	3.94%
D160217	13,455,640	0.34%	0.34%	0	0.00%	0.00%
D160413	1,885,850	0.05%	0.05%	0	0.00%	0.00%
D160803	0	0.00%	0.00%	29,666,187	0.71%	0.72%
MÁK 2016/C	116,624,325	2.95%	2.97%	0	0.00%	0.00%
MÁK 2020/P	0	0.00%	0.00%	96,730,392	2.33%	2.36%
Platina Pí Származtatott Befektetési Alap "A sorozat"	1,089,334,634	27.57%	27.78%	1,074,636,362	25.87%	26.24%
Topix ETF 1306	27,918,997	0.71%	0.71%	0	0.00%	0.00%
Banki egyenlegek	51,078,329	1.29%	1.30%	53,400,867	1.29%	1.30%
EUR	906,551	0.02%	0.02%	116,869	0.00%	0.00%
HUF	160,584	0.00%	0.00%	165,069	0.00%	0.00%
USD	50,011,194	1.27%	1.28%	53,118,930	1.28%	1.30%
Követelések (ügyfélszámla)	2,933	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
HUF	2,933	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Egyéb eszközök	-10,616,851	-0.27%	-0.27%	197,644,629	4.76%	4.83%
Összes eszköz	3,951,051,941	100.00%	100.76%	4,153,908,390	100.00%	101.44%
Kötelezettségek	29,677,494	0.75%	0.76%	59,105,913	1.42%	1.44%
Kötelezettségek értékpapír vásárlásból	28,737,094	0.73%	0.73%	50,624,159	1.22%	1.24%
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%	7,040,246	0.17%	0.17%
Letétkezelési díj	130,402	0.00%	0.00%	135,234	0.00%	0.00%
Felügyeleti díj	229,000	0.01%	0.01%	253,000	0.01%	0.01%
Könyvelési díj	87,381	0.00%	0.00%	346,674	0.01%	0.01%

Könyvvizsgálati díj	130,480	0.00%	0.00%	254,000	0.01%	0.01%
Forgalomban tartási díj	0	0.00%	0.00%	100,517	0.00%	0.00%
Bizományosi díj	15,100	0.00%	0.00%	9,592	0.00%	0.00%
Forgalmazói díj	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Befektetési alap különadója	52,809	0.00%	0.00%	39,993	0.00%	0.00%
Devizaváltás eredménye	295,228	0.01%	0.01%	302,499	0.01%	0.01%
Nettó eszközérték	3,921,374,448	99.25%	100.00%	4,094,802,476	98.58%	100.00%

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

1,427,180,649 db

III. Egy Befektetési jegyre eső Nettó eszközérték (befektetési jegy névértéke 0.01 USD)

0.010092

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	454,490	3.37%	444,605	3.09%
a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
egyéb átruházható értékpapírok	13,013,573	96.36%	13,283,853	92.23%
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
Származtatott pozíciók értéke	-36,564	-0.27%	150,774	1.05%
Nettó eszközérték	13,504,600	100.00%	14,403,004	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: 1.

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 USD PB3 Alapok Alapja	2016.01.29	195
Concorde USD PB3 Alapok Alapja	2016.02.29	192
Concorde USD PB3 Alapok Alapja	2016.03.31	192
Concorde USD PB3 Alapok Alapja	2016.04.29	192
Concorde USD PB3 Alapok Alapja	2016.05.31	191
Concorde USD PB3 Alapok Alapja	2016.06.30	193

A Fenti táblázat mutatja az ABA által alkalmazott tőkeáttétel mértékének változását a 2016 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 alapban 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.