



SUI GENERIS 1.1 SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI  
ALAP

Féléves jelentés

2016.

## FÉLÉVES JELENTÉS

A SUI Generis 1.1 Származtatott Befektetési Alap Féléves jelentése a 2014. évi XVI. törvény 6. számú melléklete alapján készült.

## I. Vagyongkimutatás

	2015.12.31			2016.06.30		
	Piaci érték	Portfólió arányában	Nettó eszközérték arányában	Piaci érték	Portfólió arányában	Nettó eszközérték arányában
<b>Átruházható értékpapírok</b>	<b>1,059,407,381</b>	<b>95.01%</b>	<b>95.30%</b>	<b>1,064,417,521</b>	<b>95.96%</b>	<b>96.86%</b>
MÁK 2019/B	33,521,506	3.01%	3.02%	33,537,067	3.02%	3.05%
MÁK 2020/N	193,276,650	17.33%	17.39%	187,077,100	16.87%	17.02%
MÁK 2016/C	43,751,249	3.92%	3.94%	0	0.00%	0.00%
MÁK 2017/K	84,226,545	7.55%	7.58%	83,002,258	7.48%	7.55%
MÁK 2020/O	132,532,560	11.89%	11.92%	128,281,440	11.56%	11.67%
D160217	1,308,604	0.12%	0.12%	0	0.00%	0.00%
D160413	76,401,929	6.85%	6.87%	0	0.00%	0.00%
MAGNOLIA 4% PERP (2016/03/20)	31,332,870	2.81%	2.82%	0	0.00%	0.00%
TOPIX ETF 1306	3,211,548	0.29%	0.29%	0	0.00%	0.00%
Concorde Hozamkereső Európai Származtatott Részvény Befektetési Alap	12,498,342	1.12%	1.12%	13,926,432	1.26%	1.27%
Concorde VM Abszolút Származtatott Alap	103,649,097	9.30%	9.32%	105,346,945	9.50%	9.59%
Citadella Származtatott Befektetési Alap	70,566,303	6.33%	6.35%	70,775,321	6.38%	6.44%
Concorde Columbus Befektetési Alap	95,446,431	8.56%	8.59%	95,566,535	8.62%	8.70%
Platina Pí Származtatott Befektetési Alap "A sorozat"	95,828,044	8.59%	8.62%	95,797,156	8.64%	8.72%
Concorde Részvény Befektetési Alap	33,229,436	2.98%	2.99%	37,160,036	3.35%	3.38%
Carion Igatlan Befektetési Alap	5,841,536	0.52%	0.53%	6,170,039	0.56%	0.56%
Concorde Közép-európai Részvény Alap	20,375,569	1.83%	1.83%	20,596,770	1.86%	1.87%
Concorde Nemzetközi Részvény Alapok Alapja	17,730,514	1.59%	1.60%	18,842,109	1.70%	1.71%
Concorde USD Pénzpiaci Alap	4,678,648	0.42%	0.42%	4,662,466	0.42%	0.42%
D160713	0	0.00%	0.00%	98,239,831	8.86%	8.94%
D160720	0	0.00%	0.00%	36,902,574	3.33%	3.36%
D160803	0	0.00%	0.00%	6,414,851	0.58%	0.58%
D160810	0	0.00%	0.00%	22,118,591	1.99%	2.01%
<b>Banki egyenlegek</b>	<b>55,396,657</b>	<b>4.97%</b>	<b>4.98%</b>	<b>46,685,062</b>	<b>4.21%</b>	<b>4.25%</b>
EUR	13,245,806	1.19%	1.19%	46,527,408	4.19%	4.23%
HUF	42,150,851	3.78%	3.79%	157,654	0.01%	0.01%
<b>Követelések (ügyfélszámla)</b>	<b>8,755</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>	<b>0</b>	<b>0.00%</b>	<b>0.00%</b>
HUF	8,755	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
<b>Egyéb eszközök</b>	<b>184,607</b>	<b>0.02%</b>	<b>0.02%</b>	<b>-1,866,300</b>	<b>-0.17%</b>	<b>-0.17%</b>
<b>Összes eszköz</b>	<b>1,114,997,400</b>	<b>100.00%</b>	<b>100.30%</b>	<b>1,109,236,284</b>	<b>100.00%</b>	<b>100.94%</b>
<b>Kötelezettségek</b>	<b>3,388,517</b>	<b>0.30%</b>	<b>0.30%</b>	<b>10,308,111</b>	<b>0.93%</b>	<b>0.94%</b>
Kötelezettségek értékpapír vásárlásból	0	0.00%	0.00%	9,487,909	0.86%	0.86%
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	2,536,888	0.23%	0.23%	0	0.00%	0.00%
Letétkezelési díj	70,452	0.01%	0.01%	67,047	0.01%	0.01%
Felügyeleti díj	69,000	0.01%	0.01%	68,000	0.01%	0.01%
Könyvelési díj	173,337	0.02%	0.02%	346,674	0.03%	0.03%
Könyvvizsgálati díj	440,471	0.04%	0.04%	250,144	0.02%	0.02%
Bizományosi díj	18,636	0.00%	0.00%	9,800	0.00%	0.00%
Forgalmazói díj	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Befektetési alap különadója	79,733	0.01%	0.01%	78,537	0.01%	0.01%
<b>Nettó eszközérték</b>	<b>1,111,608,883</b>	<b>99.70%</b>	<b>100.00%</b>	<b>1,098,928,172</b>	<b>99.07%</b>	<b>100.00%</b>

**II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma**

1,005,489,046 db

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

1.092661

**IV. Befektetési alap összetétele**

Befektetési Alap Összetétele				
Megnevezés	Nyitó állomány (e Ft)	NAV százalékában (%)	Záró állomány (e Ft)	NAV százalékában (%)
Tőzsdén hivatalosan jegyzett értékpapírok	31,332,870	2.82%	0	0.00%
más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	565,019,043	50.84%	595,573,712	54.21%
a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
egyéb átruházható értékpapírok	463,055,468	41.66%	468,843,809	42.67%
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
Származtatott pozíciók értéke	184,607	0.02%	-4,862,873	-0.44%
Nettó eszközérték	1,111,452,017	100.00%	1,098,659,153	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 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 kitettség (tőkeáttétel) mértéke (%)
Sui Generis 1.1 Származtatott Befektetési Alap	2016.01.29	100
Sui Generis 1.1 Származtatott Befektetési Alap	2016.02.29	100
Sui Generis 1.1 Származtatott Befektetési Alap	2016.03.31	100
Sui Generis 1.1 Származtatott Befektetési Alap	2016.04.29	100
Sui Generis 1.1 Származtatott Befektetési Alap	2016.05.31	194
Sui Generis 1.1 Származtatott Befektetési Alap	2016.06.30	197

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 800%.

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.