

CONCORDE
ALAPKEZELŐ

CONCORDE HOLD ALAPOK ALAPJA

Féléves jelentés

2016.

FÉLÉVES JELENTÉS

A Concorde Hold 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	33,364,046,175	99.72%	99.98%	32,443,439,996	100.00%	100.01%
Citadella Származtatott Befektetési Alap	4,354,781,664	13.02%	13.05%	4,275,849,143	13.18%	13.18%
Concorde Columbus Befektetési Alap	7,004,357,100	20.94%	20.99%	6,929,482,255	21.36%	21.36%
Concorde Rövid Kötvény Befektetési Alap	1,846,998,312	5.52%	5.53%	1,783,198,833	5.50%	5.50%
Concorde VM Abszolút Származtatott Alap	9,997,583,737	29.88%	29.96%	9,445,434,377	29.11%	29.12%
D160120	669,703	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
D160217	81,143,409	0.24%	0.24%	0	0.00%	0.00%
D160413	37,188,192	0.11%	0.11%	0	0.00%	0.00%
D160720	0	0.00%	0.00%	43,999,223	0.14%	0.14%
D160803	338,167	0.00%	0.00%	141,846,148	0.44%	0.44%
D160810	0	0.00%	0.00%	10,529,808	0.03%	0.03%
D160928	0	0.00%	0.00%	4,739,930	0.01%	0.01%
Platina Pí Származtatott Befektetési Alap "B sorozat"	10,040,985,891	30.01%	30.09%	9,808,360,279	30.23%	30.24%
Banki egyenlegek	93,162,992	0.28%	0.28%	152,280	0.00%	0.00%
HUF	93,162,992	0.28%	0.28%	152,280	0.00%	0.00%
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	33,457,209,167	100.00%	100.26%	32,443,592,276	100.00%	100.01%
Kötelezettségek	85,815,937	0.26%	0.26%	3,782,163	0.01%	0.01%
Kötelezettségek értékpapír vásárlásból	82,195,597	0.25%	0.25%	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%
Letétkezelési díj	1,126,655	0.00%	0.00%	1,072,320	0.00%	0.00%
Felügyeleti díj	2,043,000	0.01%	0.01%	2,055,000	0.01%	0.01%
Könyvelési díj	173,337	0.00%	0.00%	346,674	0.00%	0.00%
Könyvvizsgálati díj	242,859	0.00%	0.00%	250,144	0.00%	0.00%
Bizományosi díj	14,200	0.00%	0.00%	34,200	0.00%	0.00%
Forgalmazói díj	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Befektetési alap különadója	20,289	0.00%	0.00%	23,825	0.00%	0.00%
Nettó eszközérték	33,371,393,230	99.74%	100.00%	32,439,810,113	99.99%	100.00%

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

22,290,366,675 db

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

1.455316

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	119,339,471	0.36%	201,115,109	0.62%
a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
egyéb átruházható értékpapírok	33,244,706,704	99.62%	32,242,324,887	99.39%
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
Származtatott pozíciók értéke	0	0.00%	0	0.00%
Nettó eszközérték	33,371,215,147	100.00%	32,439,538,156	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: 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 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 kitérttség (tőkeáttétel) mértéke (%)
Concorde Hold Alapok Alapja	2016.01.29	100
Concorde Hold Alapok Alapja	2016.02.29	100
Concorde Hold Alapok Alapja	2016.03.31	100
Concorde Hold Alapok Alapja	2016.04.29	100
Concorde Hold Alapok Alapja	2016.05.31	100
Concorde Hold Alapok Alapja	2016.06.30	100

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 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.