

# privátvagyonkezelés

©|CONCORDE ALAPKEZELŐ

## CONCORDE EURO PÉNZPIACI BEFEKTETÉSI ALAP

Féléves jelentés

2015.

A Concorde Euro Pénzpiaci Befektetési Alap Féléves jelentése a 2014. évi XVI. törvény 6. számú melléklete alapján készült.

## I. Vagyongkimutatás

Vagyongkimutatás										
	Tárgynap (T):	2014.12.31					2015.06.30			
I.	KÖTELEZETTSÉGEK		Összeg/Érték	Devi zan em	(%)	KÖTELEZETTSÉGEK		Összeg/Érték	Devi zan em	(%)
I/1.	Hitelállomány (összes):		0	Ft		Hitelállomány (összes):		0	Ft	
I/2.	Egyéb kötelezettségek (összes):		899,286	Ft	58.55%	Egyéb kötelezettségek (összes):		916,034	Ft	60.84%
	Alapkezelői díj miatt		546,649	Ft	35.59%	Alapkezelői díj miatt		530,285	Ft	35.22%
	Letétkezelői díj miatt		35,560	Ft	2.32%	Letétkezelői díj miatt		4,001	Ft	0.27%
	Bizományosi díj miatt		6,219	Ft	0.40%	Bizományosi díj miatt		23,902	Ft	1.59%
	Forgalmazói költség miatt		270,858	Ft	17.63%	Forgalmazói költség miatt		230,146	Ft	15.29%
	Közzétételi költség miatt			Ft		Közzétételi költség miatt			Ft	
	Különadó miatt			Ft		Különadó miatt		85,700	Ft	5.69%
	Tranzakciós díj miatt			Ft		Tranzakciós díj miatt			Ft	
	Sikerdíj miatt			Ft		Sikerdíj miatt			Ft	
	Költségként elszámolt egyéb tétel (Felügyeleti díj)		40,000	Ft	2.60%	Költségként elszámolt egyéb tétel (Felügyeleti díj)		42,000	Ft	2.79%
	Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség		0	Ft		Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség		0	Ft	
I/3.	Céltartalékok (összes):		0	Ft		Céltartalékok (összes):		0	Ft	
I/4.	Passzív időbeli elhatárolások (összes):		636,653	Ft	41.45%	Passzív időbeli elhatárolások (összes):		589,533	Ft	39.16%
	Könyvvizsgálat		471,570	Ft	30.70%	Könyvvizsgálat		242,859	Ft	16.13%
	Könyvelés		165,083	Ft	10.75%	Könyvelés		346,674	Ft	23.03%
	Hirdetési díj		0	Ft		Hirdetési díj		0	Ft	
	Bankköltség		0	Ft		Bankköltség		0	Ft	
	Transzfer érkeztetett ép bek.ért. elhatárolása			Ft		Transzfer érkeztetett ép bek.ért. elhatárolása			Ft	
	<b>Kötelezettségek összesen:</b>		<b>1,535,939</b>	<b>Ft</b>	<b>100.00%</b>	<b>Kötelezettségek összesen:</b>		<b>1,505,567</b>	<b>Ft</b>	<b>100.00%</b>
II.	ESZKÖZÖK		Összeg/Érték	Devi zan em	(%)	ESZKÖZÖK		Összeg/Érték	Devi zan em	(%)
II/1.	Folyószámla, készpénz (összes):	64,072,042	64,072,042	Ft	10.96%	Folyószámla, készpénz (összes):		91,663,910	Ft	13.30%
	Elszámolási betétszámla HUF		154,136	Ft	0.03%	Elszámolási betétszámla HUF		154,103	Ft	0.02%
	Devizabetétszámla- USD		0	Ft		Devizabetétszámla- USD		0	Ft	
	Devizabetétszámla - EUR		63,917,906	Ft	10.94%	Devizabetétszámla - EUR		91,509,807	Ft	13.28%

CONCORDE EURO PÉNZPIACI BEFEKTETÉSI ALAP  
Féléves jelentés (2015)

II/2.	Egyéb követelés (összes):		124,340,154	Ft	21.28%	Egyéb követelés (összes):		124,589,181	Ft	18.08%
	Concorde Rt ügyfélszámla		4,102	Ft	0.00%	Concorde Rt ügyfélszámla		0	Ft	
	Devizapénzszámla-USD		0	Ft		Devizapénzszámla-USD		0	Ft	
	Követelések értékpapír eladásból		0	Ft		Követelések értékpapír eladásból		0	Ft	
	Követelések értékpapír kölcsönadásból		124,336,052	Ft	21.28%	Követelések értékpapír kölcsönadásból		124,589,181	Ft	18.08%
II/2.1.	Származtatott ügyletek értékelési különb		13,336,675	Ft	2.28%	Származtatott ügyletek értékelési különb		4,100,022	Ft	0.59%
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):	38,272	381,974,613	Ft	65.37%	Értékpapírok (összes):	46,814	468,440,487	Ft	67.98%
II/4.1.	Állampapírok (összes):	38,272	381,974,613	Ft	65.37%	Állampapírok (összes):	46,814	468,440,487	Ft	67.98%
II/4.1.1.	Kötvények (összes):	0	0	Ft		Kötvények (összes):	0	0	Ft	
II/4.1.2.	Kincstárjegyek (összes):	38,272	381,974,613	Ft	65.37%	Kincstárjegyek (összes):	46,814	468,440,487	Ft	67.98%
	D150121	14,866	148,536,167	Ft	25.42%	D150701	9,631	96,509,489	Ft	14.00%
	D150204	10,006	99,921,115	Ft	17.10%	D150722	14,932	149,541,155	Ft	21.70%
	D150401	13,400	133,517,331	Ft	22.85%	D150812	10,000	100,089,185	Ft	14.52%
				Ft		D150909	8,557	85,579,173	Ft	12.42%
				Ft		D160413	3,694	36,721,485	Ft	5.33%
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):	0	0	Ft		Részvények (összes):	0	0	Ft	
II/4.3.1.	Tőzsdére bevezetett (összes):	0	0	Ft		Tőzsdére bevezetett (összes):	0	0	Ft	
II/4.3.2.	Külföldi részvények (összes):	0	0	Ft		Külföldi részvények (összes):	0	0	Ft	
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	0	0	Ft		Befektetési jegyek	0	0	Ft	

	(összes):					(összes):				
II/4.5.1.	Tőzsdére bevezetett (összes):	0	0	Ft		Tőzsdére bevezetett (összes):	0	0	Ft	
II/4.5.2.	Tőzsdén kívüli (összes):	0	0	Ft		Tőzsdén kívüli (összes):	0	0	Ft	
II/4.6.	Kárpótlási jegy (összes):	0	0	Ft		Kárpótlási jegy (összes):	0	0	Ft	
II/5.	Aktív időbeli elhatárolások (összes):	0	616,810	Ft	0.11%	Aktív időbeli elhatárolások (összes):	0	336,375	Ft	0.05%
	ESZKÖZÖK ÖSSZESEN:	64,110,314	584,340,294	Ft	100.00%	ESZKÖZÖK ÖSSZESEN:	46,814	689,129,974	Ft	100.00%

## II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

215,604,086 db

## III. Egy Befektetési jegyre eső Nettó eszközérték (EUR)

0.010123

## IV. Befektetési alap összetétele

Befektetési Alap Összetétele				
Megnevezés	Nyitó állomány (EUR)	NAV százalékában (%)	Záró állomány (EUR)	NAV százalékában (%)
Tőzsdén hivatalosan jegyzett értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	1,607,897	86.87%	1,882,394	86.24%
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb átruházható értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
Származtatott pozíciók értéke	42,353	2.29%	13,015	0.60%
Nettó eszközérték	1,850,838	100.00%	2,182,664	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: 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 EURÓ PÉNZPIACI BEFEKTETÉSI ALAP	2015.01.30	162
CONCORDE EURÓ PÉNZPIACI BEFEKTETÉSI ALAP	2015.02.27	156
CONCORDE EURÓ PÉNZPIACI BEFEKTETÉSI ALAP	2015.03.31	156
CONCORDE EURÓ PÉNZPIACI BEFEKTETÉSI ALAP	2015.04.30	175
CONCORDE EURÓ PÉNZPIACI BEFEKTETÉSI ALAP	2015.05.29	175
CONCORDE EURÓ PÉNZPIACI BEFEKTETÉSI ALAP	2015.06.30	167

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 alapban 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.