

privátvagyonkezelés

©|CONCORDE ALAPKEZELŐ

CONCORDE PB1 ALAPOK ALAPJA

Féléves jelentés

2015.

A Concorde PB1 Alapok Alapja Féléves jelentése a 2014. évi XVI. törvény 6. számú melléklete alapján készült.

I. Vagyongkimutatás

Vagyongkimutatás									
	Tárgy nap (T):	2014.12.31				2015.06.30			
I.	KÖTELEZETTSÉGEK		Összeg/Érték	Devizanem	(%)	KÖTELEZETTSÉGEK	Összeg/Érték	Devizanem	(%)
I/1.	Hitelállomány (összes):		0	Ft		Hitelállomány (összes):	0	Ft	
I/2.	Egyéb kötelezettségek (összes):		188,182,117	Ft	99.28%	Egyéb kötelezettségek (összes):	51,191,562	Ft	62.71%
	Alapkezelői díj miatt		0	Ft		Alapkezelői díj miatt	0	Ft	
	Letétkezelői díj miatt			Ft		Letétkezelői díj miatt	518,024	Ft	0.63%
	Bizományosi díj miatt			Ft		Bizományosi díj miatt		Ft	
	Forgalmazói költség miatt			Ft		Forgalmazói költség miatt		Ft	
	Közzétételi költség miatt			Ft		Közzétételi költség miatt		Ft	
	Különadó miatt			Ft		Különadó miatt	366,546	Ft	0.45%
	Tranzakciós díj miatt			Ft		Tranzakciós díj miatt	27,855	Ft	0.03%
	Forgalomban tartási díj miatt			Ft		Forgalomban tartási díj miatt	390,717	Ft	0.48%
	Költségként elszámolt egyéb tétel (Felügyeleti díj)		976,000	Ft	0.51%	Költségként elszámolt egyéb tétel (Felügyeleti díj)	982,000	Ft	1.20%
	Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség		187,206,117	Ft	98.77%	Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség	48,906,420	Ft	59.91%
I/3.	Céltartalékok (összes):		0	Ft		Céltartalékok (összes):	0	Ft	
	Marketing		0	Ft		Marketing	0	Ft	
I/4.	Passzív időbeli elhatárolások (összes):		1,358,001	Ft	0.72%	Passzív időbeli elhatárolások (összes):	30,438,357	Ft	37.29%
	Könyvvizsgálati díj		235,785	Ft	0.12%	Könyvvizsgálati díj	242,859	Ft	0.30%
	Könyvelési díj		165,083	Ft	0.09%	Könyvelési díj	346,674	Ft	0.42%
	Tranzakciós díj		27,000	Ft	0.01%	Tranzakciós díj		Ft	
	Forgalmazási jutalék		389,639	Ft	0.21%	Forgalmazási jutalék		Ft	
	Letétkezelési díj		540,494	Ft	0.29%	Letétkezelési díj		Ft	
	Sikerdíj			Ft		Sikerdíj	29,848,824	Ft	36.57%
	Kötelezettségek összesen:		189,540,118	Ft	100.00%	Kötelezettségek összesen:	81,629,919	Ft	100.00%
II.	ESZKÖZÖK		Összeg/Érték	Devizanem	(%)	ESZKÖZÖK	Összeg/Érték	Devizanem	(%)
II/1.	Folyószámla, készpénz (összes):		620,233	Ft	0.00%	Folyószámla, készpénz (összes):	618,696	Ft	0.00%
	Elszámolási betétszámla		154,668	Ft	0.00%	Elszámolási betétszámla	127,309	Ft	0.00%

CONCORDE PB1 ALAPOK ALAPJA

Féléves jelentés (2015)

	HUF					HUF				
	Devizabetéts zámla-USD		313,407	Ft	0.00%	Devizabetéts zámla-USD		339,475	Ft	0.00%
	Devizabetéts zámla - EUR		152,158	Ft	0.00%	Devizabetéts zámla - EUR		151,912	Ft	0.00%
	Valuta, deviza betétek értékelési különbözete		0	Ft		Valuta, deviza betétek értékelési különbözete		0	Ft	
	USD bank értékkülönböz ete			Ft		USD bank értékkülönböz ete		0	Ft	
	EUR bank értékkülönböz ete			Ft		EUR bank értékkülönböz ete		0	Ft	
II/2.	Egyéb követelés (összes):		10,891,120	Ft	0.07%	Egyéb követelés (összes):		1,409,555	Ft	0.01%
	Concorde Rt ügyfélszámla		0	Ft		Concorde Rt ügyfélszámla		9,450	Ft	0.00%
	Külföldi pénzértékre szóló követelések értékelési különbözete		0	Ft		Külföldi pénzértékre szóló követelések értékelési különbözete		0	Ft	
	USD Concorde értékkülönböz ete		0	Ft		USD Concorde értékkülönböz ete		0	Ft	
	EUR Concorde értékkülönböz ete		0	Ft		EUR Concorde értékkülönböz ete		0	Ft	
	Követelések értékpapír eladásból		10,891,119	Ft	0.07%	Követelések értékpapír eladásból		1,400,105	Ft	0.01%
	Követelések értékpapír kölcsönadásból		0	Ft		Követelések értékpapír kölcsönadásból		0	Ft	
	Értékpapír kölcsönből származó követelések értékelési különbözete		0	Ft		Értékpapír kölcsönből származó követelések értékelési különbözete		0	Ft	
	Határidős ügyletek változó letét		0	Ft		Határidős ügyletek változó letét		0	Ft	
II/2.1.	Származtatott ügyletek értékelési különb		-992,012	Ft	-0.01%	Származtatott ügyletek értékelési különb		-682,891	Ft	0.00%
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	
	Lekötött betétszámla		0	Ft		Lekötött betétszámla		0	Ft	
	Lekötött betét USD		0	Ft		Lekötött betét USD		0	Ft	
	Lekötött betét EUR		0	Ft		Lekötött betét EUR		0	Ft	
II/3.2.	3 hónapnál hosszabb lekötésű (összes):		0	Ft		3 hónapnál hosszabb lekötésű (összes):		0	Ft	
		Darabszám	Összeg/Érték	Devi	(%)		Darabszám	Összeg/Érték	Devi	(%)

CONCORDE PB1 ALAPOK ALAPJA

Féléves jelentés (2015)

				zan					zan	
				em					em	
II/4.	Értékpapírok (összes):	6,228,117,830	16,138,378,823	Ft	99.93%	Értékpapírok (összes):	6,220,209,700	15,871,829,393	Ft	99.99%
II/4.1.	Állampapírok (összes):	2,435,199,542	3,032,108,611	Ft	18.78%	Állampapírok (összes):	2,575,189,696	3,017,474,845	Ft	19.01%
II/4.1.1.	Kötvények (összes):	2,435,168,837	2,725,872,988	Ft	16.88%	Kötvények (összes):	2,575,168,837	2,809,084,330	Ft	17.70%
	MÁK 2020/N	1,891,190,913	2,126,994,052	Ft	13.17%	MÁK 2020/N	2,031,190,913	2,198,022,779	Ft	13.85%
	MÁK 2020/O	43,977,924	48,949,936	Ft	0.30%	MÁK 2020/O	43,977,924	47,590,051	Ft	0.30%
	MÁK 2020/P	500,000,000	549,929,000	Ft	3.41%	MÁK 2020/P	500,000,000	563,471,500	Ft	3.55%
II/4.1.2.	Kincstárjegyek (összes):	30,705	306,235,623	Ft	1.90%	Kincstárjegyek (összes):	20,859	208,390,515	Ft	1.31%
	D150107	9,402	93,993,862	Ft	0.58%	D150701	152	1,519,957	Ft	0.01%
	D150204	110	1,098,473	Ft	0.01%	D150708	7,467	74,653,274	Ft	0.47%
	D150218	95	948,154	Ft	0.01%	D150722	134	1,339,173	Ft	0.01%
	D150401	11,660	116,180,007	Ft	0.72%	D150729	6,447	64,417,586	Ft	0.41%
	D150408	9,438	94,015,127	Ft	0.58%	D150812	1,294	12,924,407	Ft	0.08%
				Ft		D150909	3,517	35,100,082	Ft	0.22%
				Ft		D150923	1,848	18,436,036	Ft	0.12%
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	7,631	23,863,062	Ft	0.15%	Gazdálkodói és egyéb hitelviszonyt megtestesítő	7,631	29,400,126	Ft	0.19%
II/4.2.1.	Tőzsdére bevezetett (összes):	7,631	23,863,062	Ft	0.15%	Tőzsdére bevezetett (összes):	7,631	29,400,126	Ft	0.19%
	TOPIX ETF 1306	7,631	23,863,062	Ft	0.15%	TOPIX ETF 1306	7,631	29,400,126	Ft	0.19%
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 (összes):	3,792,910,657	13,082,407,150	Ft	81.01%	Befektetési jegyek (összes):	3,645,012,373	12,824,954,422	Ft	80.80%
II/4.5.1.	Tőzsdére bevezetett (összes):	3,433,844,251	12,654,442,563	Ft	78.36%	Tőzsdére bevezetett (összes):	3,515,121,499	12,757,626,267	Ft	80.37%
	MAG ING.BEF.ALAP ZV	82,157,441	0	Ft		MAG ING.BEF.ALAP ZV	82,157,441	0	Ft	
	NAP ING.FEJL.ALAP A - LEJÁRT	1,403	682,195	Ft	0.00%	NAP ING.FEJL.ALAP A - LEJÁRT	1,403	476,758	Ft	0.00%

CONCORDE PB1 ALAPOK ALAPJA

Féléves jelentés (2015)

	NAP ING.FEJL.BEF.A LAP B - LEJÁRT	158	78,372	Ft	0.00%	NAP ING.FEJL.BEF.A LAP B - LEJÁRT	158	54,771	Ft	0.00%
	CONCORDE COLUMBUS BEF.ALAP	386,725,632	654,386,176	Ft	4.05%	CONCORDE COLUMBUS BEF.ALAP	358,166,318	641,904,242	Ft	4.04%
	CONCORDE RÉSZVÉNY	36,248,466	213,727,951	Ft	1.32%	CONCORDE RÉSZVÉNY ALAP	30,990,794	206,085,495	Ft	1.30%
	CONCORDE RÖVID KÖTVÉNY	2,736,989,298	11,136,593,231	Ft	68.96%	CONCORDE RÖVID KÖTVÉNY ALAP	2,654,101,612	10,923,260,406	Ft	68.82%
	PLATINA PÍ SZÁRM.ALAP A	191,721,853	648,974,638			CONCORDE KONVERGENCI A RV.ALAP	47,903,014	58,134,762	Ft	0.37%
						PLATINA PÍ SZÁRM.ALAP A	185,921,917	638,849,832	Ft	4.02%
						CONCORDE KÖZÉP EURÓPAI RV.ALAP	62,566,934	70,032,859	Ft	0.44%
						CONCORDE NK. RV.ALAPOK ALAPJA	81,819,105	187,152,366	Ft	1.18%
									Ft	
									Ft	
						CONCORDE USD PÉNZPIACI ALAP	11,492,803	31,674,776	Ft	0.20%
II/4.5.2.	Tőzsdén kívüli (összes):	359,066,406	427,964,587	Ft	2.65%	Tőzsdén kívüli (összes):	129,890,874	67,328,155	Ft	0.42%
	CARION ING.BEF.ALAP	129,890,874	62,546,612	Ft	0.39%	CARION ING.BEF.ALAP	129,890,874	67,328,155	Ft	0.42%
	CONCORDE KONVERGENCI A RV.ALAP	62,163,984	69,093,714	Ft	0.43%				Ft	
	CONCORDE KÖZÉP- EURÓPAI RV.ALAP	55,130,210	56,521,366	Ft	0.35%				Ft	
	CONCORDE NK. RV. ALAPOK ALAPJA	95,675,926	198,397,714	Ft	1.23%				Ft	
	CONCORDE USD PÉNZPIACI ALAP	16,205,412	41,405,181	Ft	0.26%				Ft	
II/4.6.	Kárpótlási jegy (összes):	0	0	Ft		Kárpótlási jegy (összes):	0	0	Ft	
	KPJ			Ft		KPJ			Ft	
II/5.	Aktív időbeli elhatárolások (összes):	0	0	Ft		Aktív időbeli elhatárolások (összes):	0	0	Ft	
	AIEH		0	Ft		AIEH		0	Ft	
	AIEH értékvesztése		0	Ft		AIEH értékvesztése		0	Ft	
	ESZKÖZÖK ÖSSZESEN:	6,228,117,830	16,148,898,164	Ft	100.00%	ESZKÖZÖK ÖSSZESEN:	6,220,209,700	15,873,174,753	Ft	100.00%

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

8,445,140,520 db

III. Egy Befektetési jegyre eső Nettó eszközérték

1.869901

IV. Befektetési alap összetétele

Befektetési Alap Összetétele				
Megnevezés	Nyitó állomány	NAV százalékában (%)	Záró állomány	NAV százalékában (%)
Tőzsdén hivatalosan jegyzett értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	3,032,108,611	19.00%	3,017,474,845	19.11%
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb átruházható értékpapírok	13,106,270,212	82.12%	12,854,354,548	81.40%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
Származtatott pozíciók értéke	-992,012	-0.01%	-682,891	0.00%
Nettó eszközérték	15,959,361,529	100.00%	15,791,580,606	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: 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=SRRRI) 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 kitétség (tőkeáttétel) mértéke (%)
CONCORDE PB1 ALAPOK ALAPJA	2015.01.30	100
CONCORDE PB1 ALAPOK ALAPJA	2015.02.27	100
CONCORDE PB1 ALAPOK ALAPJA	2015.03.31	100
CONCORDE PB1 ALAPOK ALAPJA	2015.04.30	100
CONCORDE PB1 ALAPOK ALAPJA	2015.05.29	100
CONCORDE PB1 ALAPOK ALAPJA	2015.06.30	100

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 alapon 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.