

privátvagyonkezelés

©|CONCORDE ALAPKEZELŐ

PLATINA BÉTA SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP

Féléves jelentés

2015.

A Platina Béta Származtatott 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	Devizanem	(%)	KÖTELEZETTSÉGEK	Összeg/Érték	Devizanem	(%)
I/1.	Hitelállomány (összes):		0	Ft		Hitelállomány (összes):	0	Ft	
I/2.	Egyéb kötelezettségek (összes):		404,965,041	Ft	99.88%	Egyéb kötelezettségek (összes):	23,607,324	Ft	97.71%
	Alapkezelői díj miatt		797,207	Ft	0.20%	Alapkezelői díj miatt	750,770	Ft	3.11%
	Letétkezelői díj miatt		0	Ft		Letétkezelői díj miatt	103,958	Ft	0.43%
	Bizományosi díj miatt		0	Ft		Bizományosi díj miatt	13,655	Ft	0.06%
	Forgalmazói költség miatt		0	Ft		Forgalmazói költség miatt	0	Ft	
	Közzétételi költség miatt		0	Ft		Közzétételi költség miatt	0	Ft	
	Különadó miatt		0	Ft		Különadó miatt	161,773	Ft	0.67%
	Tranzakciós díj miatt		0	Ft		Tranzakciós díj miatt	0	Ft	
	Sikerdíj miatt		0	Ft		Sikerdíj miatt	0	Ft	
	Költséggént elszámolt egyéb tétel (Felügyeleti díj)		106,000	Ft	0.03%	Költséggént elszámolt egyéb tétel (Felügyeleti díj)	111,000	Ft	0.46%
	Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség		404,061,834	Ft	99.66%	Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség	22,466,168	Ft	92.99%
I/3.	Céltartalékok (összes):		0	Ft		Céltartalékok (összes):	0	Ft	
I/4.	Passzív időbeli elhatárolások (összes):		474,721	Ft	0.12%	Passzív időbeli elhatárolások (összes):	552,211	Ft	2.29%
	Könyvvizsgálat		199,550	Ft	0.05%	Könyvvizsgálat	205,537	Ft	0.85%
	Könyvelés		165,083	Ft	0.04%	Könyvelés	346,674	Ft	1.43%
	Hirdetési díj		0	Ft		Hirdetési díj		Ft	
	Bankköltség		0	Ft		Bankköltség		Ft	
	Transzfer érkezett ép bek.ért. elhatárolása		0	Ft		Transzfer érkezett ép bek.ért. elhatárolása		Ft	
	Letétkezelői díj		102,888	Ft	0.03%	Letétkezelői díj		Ft	
	Bizományosi díj		7,200	Ft	0.00%	Bizományosi díj		Ft	
	Kötelezettségek összesen:		405,439,762	Ft	100.00%	Kötelezettségek összesen:	24,159,535	Ft	100.00%
II.	ESZKÖZÖK		Összeg/Érték	Devizanem	(%)	ESZKÖZÖK	Összeg/Érték	Devizanem	(%)
II/1.	Folyószámla, készpénz (összes):		1,662,227	Ft	0.08%	Folyószámla, készpénz (összes):	7,809,620	Ft	0.43%
	Elszámolási betétszámla HUF		148,635	Ft	0.01%	Elszámolási betétszámla HUF	38,747	Ft	0.00%
	Devizabetétszámla-USD		35,331	Ft	0.00%	Devizabetétszámla-USD	1,641,370	Ft	0.09%
	Devizabetétszámla		1,334,351	Ft	0.06%	Devizabetétszámla	5,770,759	Ft	0.32%

PLATINA BÉTA SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP
Féléves jelentés (2015)

	la - EUR					la - EUR				
	Devizabetétszám					Devizabetétszám				
	la-GBP		143,910	Ft	0.01%	la-GBP		358,744	Ft	0.02%
II/2.	Egyéb követelés (összes):		348,597,099	Ft	16.44%	Egyéb követelés (összes):		344,946,310	Ft	19.12%
	Concorde Rt ügyfélszámla		9,766	Ft	0.00%	Concorde Rt ügyfélszámla		7,102	Ft	0.00%
	Devizapénzszámla-USD		38,845,563	Ft	1.83%	Devizapénzszámla-USD		36,467,508	Ft	2.02%
	Követelések értékpapír kölcsönadásból		309,741,770	Ft	14.61%	Követelések értékpapír kölcsönadásból		308,471,700	Ft	17.09%
	Értékpapír kölcsönből származó követelések értékelési különbözete			Ft		Értékpapír kölcsönből származó követelések értékelési különbözete			Ft	
	Határidős ügyletek változó letét		0	Ft		Határidős ügyletek változó letét		0	Ft	
II/2.1.	Származtatott ügyletek értékelési különb		-317,458	Ft	-0.01%	Származtatott ügyletek értékelési különb		-613,041	Ft	-0.03%
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	De viz an em	(%)		Darabszám	Összeg/Érték	Deviza nem	(%)
II/4.	Értékpapírok (összes):	188,625,973	1,768,470,698	Ft	83.41%	Értékpapírok (összes):	218,564,234	1,451,426,670	Ft	80.43%
II/4.1.	Állampapírok (összes):	89,815	898,882,414	Ft	42.39%	Állampapírok (összes):	42,336	422,062,980	Ft	23.39%
II/4.1.1.	Kötvények (összes):	0	0	Ft		Kötvények (összes):	0	0	Ft	
II/4.1.2.	Kincstárjegyek (összes):	89,815	898,882,414	Ft	42.39%	Kincstárjegyek (összes):	42,336	422,062,980	Ft	23.39%
	D150107	40,407	403,957,669	Ft	19.05%	D150722	558	5,576,557	Ft	0.31%
	D150204	845	8,438,271	Ft	0.40%	D150708	26,342	263,360,994	Ft	14.59%
	D150408	40,563	404,061,834	Ft	19.06%	D160413	15,436	153,125,429	Ft	8.49%
	K150311	8,000	82,424,640	Ft	3.89%				Ft	
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	704	319,438,332	Ft	15.07%	Gazdálkodói és egyéb hitelviszonyt megtestesítő	804	370,286,353	Ft	20.52%
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):	704	319,438,332	Ft	15.07%	Tőzsdén kívüli (összes):	804	370,286,353	Ft	20.52%
	MAGNOLIA 4% PERP (2016/03/20)	4	121,633,442	Ft	5.74%	ERSTE FIN 5.25% 2049 PERP 2015/09/23	100	28,357,705	Ft	1.57%
	MOL 6.25%	700	197,804,870	Ft	9.33%	MAGNOLIA 4%	4	124,040,138	Ft	6.87%

PLATINA BÉTA SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP
Féléves jelentés (2015)

	2019/09/26		90			PERP (2016/03/20)				
				Ft		MOL 6.25% 2019/09/26	700	217,888,510	Ft	12.07%
II/4.3.	Részvények (összes):	208,387	86,722,54 0	Ft	4.09%	Részvények (összes):	194,027	162,874,829	Ft	9.03%
II/4.3.1.	Tőzsdére bevezetett (összes):	208,387	86,722,54 0	Ft	4.09%	Tőzsdére bevezetett (összes):	194,027	162,874,829	Ft	9.03%
	ÁNY BIZTONSÁGI NYOMDA (98)	25,000	22,000,00 0	Ft	1.04%	DANUBIUS	10,640	84,694,400	Ft	4.69%
	MAGYAR TELEKOM	150,000	50,700,00 0	Ft	2.39%	MAGYAR TELEKOM	150,000	59,250,000	Ft	3.28%
	MASTERPLAST NYRT. TÖRZSRÉSZVÉNY	33,387	14,022,54 0	Ft	0.66%	MASTERPLAST NYRT. TÖRZSRÉSZVÉNY	33,387	18,930,429	Ft	1.05%
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):	188,327,067	463,427,4 12	Ft	21.86%	Befektetési jegyek (összes):	218,327,067	496,202,508	Ft	27.50%
II/4.5.1.	Tőzsdére bevezetett (összes):	138,024,353	300,603,8 32	Ft	14.18%	Tőzsdére bevezetett (összes):	138,024,353	312,980,428	Ft	17.34%
	CITADELLA SZÁRM.BEF.ALAP	19,486,761	32,253,10 3	Ft	1.52%	CITADELLA SZÁRM.BEF.ALAP	19,486,761	36,581,113	Ft	2.03%
	CONCORDE COLUMBUS BEF.ALAP	68,926,823	116,632,4 56	Ft	5.50%	CONCORDE COLUMBUS BEF.ALAP	68,926,823	123,530,376	Ft	6.85%
	CONCORDE-VM	13,284,838	28,755,72 3	Ft	1.36%	CONCORDE-VM ALAP	13,284,838	28,048,717	Ft	1.55%
	PLATINA PÍ SZÁRM.ALAP A	36,325,931	122,962,5 50	Ft	5.80%	PLATINA PÍ SZÁRM.ALAP A	36,325,931	124,820,222	Ft	6.92%
II/4.5.2.	Tőzsdén kívüli (összes):	50,302,714	162,823,5 80	Ft	7.68%	Tőzsdén kívüli (összes):	80,302,714	183,222,080	Ft	10.15%
	AEGON ALFA SZÁRMAZTATOTT ALAP	23,161,723	55,686,36 4	Ft	2.63%	AEGON ALFA SZÁRMAZTATOTT ALAP	23,161,723	57,686,888	Ft	3.20%
	OTP SUPRA SZÁRMAZTATOTT ALAP	27,140,991	107,137,2 16	Ft	5.05%	OTP SUPRA SZÁRMAZTATOTT ALAP	27,140,991	95,587,422	Ft	5.30%
				Ft		MARKETPROG TECHNICS Abszolút Hozamú Szarmaztatott Részalap	30,000,000	29,947,770	Ft	1.66%
II/4.6.	Kárpótlási jegy (összes):	0	0	Ft		Kárpótlási jegy (összes):	0	0	Ft	
II/5.	Aktív időbeli elhatárolások (összes):	0	1,858,907	Ft	0.09%	Aktív időbeli elhatárolások (összes):	0	970,494	Ft	0.05%
	AIEH		1,858,907	Ft	0.09%	AIEH		970,494	Ft	0.05%
	ESZKÖZÖK ÖSSZESEN:	188,625,973	2,120,271, 473	Ft	100.00%	ESZKÖZÖK ÖSSZESEN:	218,564,234	1,804,540,052	Ft	100.00%

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

608,451,200 db

III. Egy Befektetési jegyre eső Nettó eszközérték

2.92612

IV. Befektetési alap összetétele

Befektetési Alap Összetétele				
Megnevezés	Nyitó állomány	NAV százalékában (%)	Záró állomány	NAV százalékában (%)
Tőzsdén hivatalosan jegyzett értékpapírok	284,527,430	16.59%	533,161,182	29.95%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	1,208,624,184	70.48%	730,534,680	41.03%
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb átruházható értékpapírok	463,427,412	27.02%	496,202,508	27.87%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	121,633,442	7.09%	0	0.00%
Származtatott pozíciók értéke	-317,458	-0.02%	-613,041	-0.03%
Nettó eszközérték	1,714,826,685	100.00%	1,780,401,274	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: 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 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 (%)
PLATINA BÉTA SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP	2015.01.30	100
PLATINA BÉTA SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP	2015.02.27	100
PLATINA BÉTA SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP	2015.03.31	100
PLATINA BÉTA SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP	2015.04.30	100
PLATINA BÉTA SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP	2015.05.29	100
PLATINA BÉTA SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP	2015.06.30	110

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 800%.

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.