



**CONCORDE RUBICON SZÁRMAZTATOTT
BEFEKTETÉSI ALAP
FÉLÉVES JELENTÉS
2013.**

A Concorde Rubicon Származtatott Befektetési Alap Féléves jelentése a 2011. Évi CXCIII.
törvény 6. számú melléklete alapján készült.

I. Vagyonkimutatás

| Tárgy nap (T): | Vagyonkimutatás | | | | | | | | |
|--|-----------------|---------------------|------------------|----------------|--|------------|---------------------|------------------|----------------|
| | 2012.12.31 | | | | | 2013.06.28 | | | |
| KÖTELEZETTSÉGEK | | Összeg/Érték | Devizanem | (%) | | | Összeg/Érték | Devizanem | (%) |
| Hitelállomány (összes): | | 0 | Ft | | | | 0 | Ft | |
| Egyéb kötelezettségek (összes): | | 9,066,889 | Ft | 92.36% | | | 23,492,496 | Ft | 97.74% |
| Alapkezelői díj miatt | | 3,235,473 | Ft | 32.96% | | | 5,559,529 | Ft | 23.13% |
| Letétkezelői díj miatt | | 28,686 | Ft | 0.29% | | | 50,890 | Ft | 0.21% |
| Bizományosi díj miatt | | 0 | Ft | | | | 0 | Ft | |
| Forgalmazói költség miatt | | 0 | Ft | | | | 0 | Ft | |
| Borrowing coast | | 0 | Ft | | | | 7,290 | Ft | 0.03% |
| CFD Finance | | 0 | Ft | | | | 5,765 | Ft | 0.02% |
| Tranzakciós díj miatt | | 53,209 | Ft | 0.54% | | | 84,556 | Ft | 0.35% |
| Sikerdíj miatt | | 0 | Ft | | | | 0 | Ft | |
| Költségként elszámolt egyéb tétel (PSZÁF díj) | | 39,000 | Ft | 0.40% | | | 70,000 | Ft | 0.29% |
| Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | 5,710,521 | Ft | 58.17% | | | 17,714,466 | Ft | 73.70% |
| Céltartalékok (összes): | | 0 | Ft | | | | 0 | Ft | |
| Marketing | | 0 | Ft | | | | 0 | Ft | |
| | | | | | | | | | |
| Passzív időbeli elhatárolások (összes): | | 750,194 | Ft | 7.64% | | | 543,362 | Ft | 2.26% |
| Könyvvizsgálat | | 203,200 | Ft | 2.07% | | | 228,918 | Ft | 0.95% |
| Könyvelés | | 148,744 | Ft | 1.52% | | | 314,444 | Ft | 1.31% |
| Hírdetési díj | | 0 | Ft | | | | 0 | Ft | |
| Bankköltség | | 0 | Ft | | | | 0 | Ft | |
| Transzfer érkezett ép bek.ért. elhatárolása | | 0 | Ft | | | | 0 | Ft | |
| Opció díj | | 398,250 | Ft | 4.06% | | | 0 | Ft | |
| Kötelezettségek összesen: | | 9,817,083 | Ft | 100.00% | | | 24,035,858 | Ft | 100.00% |
| ESZKÖZÖK | | Összeg/Érték | Devizanem | (%) | | | Összeg/Érték | Devizanem | (%) |
| Folyószámla, készpénz (összes): | | 5,511,604 | Ft | 0.84% | | | 34,611,355 | Ft | 2.42% |
| Elszámolási betétszámla HUF | | 127,426 | Ft | 0.02% | | | 395,441 | Ft | 0.03% |
| Devizabetétszámla-USD | | 911,160 | Ft | 0.14% | | | 14,075,439 | Ft | 0.98% |
| Devizabetétszámla - EUR | | 1,924,139 | Ft | 0.29% | | | 877,062 | Ft | 0.06% |
| Devizabetétszámla-JPY | | 0 | Ft | | | | 0 | Ft | |
| Devizabetétszámla-CZK | | 0 | Ft | | | | 17,712,986 | Ft | 1.24% |
| Devizabetétszámla-CAD | | 0 | Ft | | | | 0 | Ft | |
| Devizabetétszámla-CHF | | 0 | Ft | | | | 0 | Ft | |
| Devizabetétszámla-GBP | | 0 | Ft | | | | 425,704 | Ft | 0.03% |
| Devizabetétszámla-PLN | | 0 | Ft | | | | 0 | Ft | |
| Devizabetétszámla-RON | | 1,653,931 | Ft | 0.25% | | | 205,656 | Ft | 0.01% |
| Devizabetétszámla-TRY | | 0 | Ft | | | | 0 | Ft | |
| Devizabetétszámla-HKD | | 0 | Ft | | | | 0 | Ft | |
| Devizabetétszámla-HRK | | 894,948 | Ft | 0.14% | | | 919,067 | Ft | 0.06% |
| Egyéb követelés (összes): | | 43,692,350 | Ft | 6.66% | | | 21,122,402 | Ft | 1.48% |
| Concorde Rt ügyfélszámla | | 0 | Ft | | | | 2,976 | Ft | 0.00% |
| Devizapénzszámla-USD | | 20,985,881 | Ft | 3.20% | | | 8,123,067 | Ft | 0.57% |
| Devizapénzszámla-EUR | | 4,092,272 | Ft | 0.62% | | | 7,963,709 | Ft | 0.56% |
| Követelések értékpapír eladásból | | 18,614,196 | Ft | 2.84% | | | 5,032,650 | Ft | 0.35% |
| Követelések értékpapír kölcsönadásból | | 0 | Ft | | | | 0 | Ft | |

| | | | | | | | | | |
|---|------------------|---------------------|------------------|---------------|---|-------------------|----------------------|------------------|---------------|
| Értékpapír kölcsönből származó követelések értékelési különbözete | | 0 | Ft | | | 0 | Ft | | |
| Határidős ügyletek változó letét | | 0 | Ft | | | 0 | Ft | | |
| Származtatott ügyletek értékelési különb | | 2,032,477 | Ft | 0.31% | | 35,688,551 | Ft | 2.49% | |
| Lekötött bankbetétek (összes): | | 0 | Ft | | | 0 | Ft | | |
| Max. 3 hó lekötésű (összes): | | 0 | Ft | | | 0 | Ft | | |
| 3 hónapnál hosszabb lekötésű (összes): | | 0 | Ft | | | 0 | Ft | | |
| | Darabszám | Összeg/Érték | Devizanem | (%) | | Darabszám | Összeg/Érték | Devizanem | (%) |
| Értékpapírok (összes): | 5,659,833 | 604,424,841 | Ft | 92.19% | | 988,631 | 1,339,685,579 | Ft | 93.61% |
| Állampapírok (összes): | 4,980,410 | 132,866,781 | Ft | 20.26% | | 201,914 | 213,854,326 | Ft | 14.94% |
| Kötvények (összes): | 0 | 0 | Ft | | | 0 | 0 | Ft | |
| Kincstárjegyek (összes): | 4,815,935 | 50,416,701 | Ft | 7.69% | | 15,914 | 189,690,471 | Ft | 13.25% |
| D130116 | 68 | 678,093 | Ft | 0.10% | D130710 | 367 | 3,664,895 | Ft | 0.26% |
| D130417 | 262 | 2,580,307 | Ft | 0.39% | D130724 | 3,660 | 36,489,834 | Ft | 2.55% |
| EFSF TREASURY BILL 06/17/2013 | 1,814,105 | 5,281,506 | Ft | 0.81% | D130904 | 653 | 6,478,844 | Ft | 0.45% |
| GERMAN TREASURY BILL 02/13/2013 | 3,000,000 | 8,737,774 | Ft | 1.33% | D130918 | 8,734 | 86,516,296 | Ft | 6.05% |
| US TREASURY BILL 02/21/2013 | 1,500 | 33,139,021 | Ft | 5.05% | US TREASURY BILL 09/19/2013 | 2,500 | 56,540,602 | Ft | 3.95% |
| Egyéb jegybankképes ép. (összes): | 6,475 | 64,635,134 | Ft | 9.86% | | 0 | 0 | Ft | |
| MNB130109 | 6,475 | 64,635,134 | Ft | 9.86% | | | | Ft | |
| Külföldi állampapírok (összes): | 158,000 | 17,814,946 | Ft | 2.72% | | 186,000 | 24,163,855 | Ft | 1.69% |
| HELLENIC REPUBLIC GGB 2% 02/24/32 | 158,000 | 17,814,946 | Ft | 2.72% | HELLENIC REP 2% 02/24/32 | 186,000 | 24,163,855 | Ft | 1.69% |
| Gazdálkodói és egyéb hitelviszonyt megtestesítő | 503 | 129,276,017 | Ft | 19.72% | | 1,198 | 402,703,043 | Ft | 28.14% |
| Tőzsdére bevezetett (összes): | 0 | 0 | Ft | | | 0 | 0 | Ft | |
| Külföldi kötvények (összes): | 503 | 129,276,017 | Ft | 19.72% | | 832 | 324,246,977 | Ft | 22.66% |
| MAGNOLIA FIN | 3 | 62,821,553 | Ft | 9.58% | MAGNOLIA FIN | 7 | 170,456,966 | Ft | 11.91% |
| OTP - OPUS | 500 | 66,454,464 | Ft | 10.14% | OTP - OPUS | 825 | 153,790,011 | Ft | 10.75% |
| Tőzsdén kívüli (összes): | 0 | 0 | Ft | | | 366 | 78,456,066 | Ft | 5.48% |
| OTPHB FLOAT 11/07/49 | 116 | 23,085,386 | | | OTPHB FLOAT 11/07/49 | 366 | 78,456,066 | Ft | 5.48% |
| Részvények (összes): | 678,920 | 342,282,043 | Ft | 52.20% | | 785,519 | 723,128,210 | Ft | 50.53% |
| Tőzsdére bevezetett (összes): | 179,962 | 130,564,033 | Ft | 19.91% | | 318,738 | 341,661,098 | Ft | 23.87% |
| ÁLLAMI NYOMDA(98) | 33,248 | 14,097,152 | Ft | 2.15% | ÁLLAMI NYOMDA(98) | 61,056 | 28,146,816 | Ft | 1.97% |
| DANUBIUS | 4,901 | 14,752,010 | Ft | 2.25% | DANUBIUS | 7,144 | 30,719,200 | Ft | 2.15% |
| GRAPHISOFT PARK SE | 67,798 | 57,967,290 | Ft | 8.84% | EGIS | 3,289 | 72,061,990 | Ft | 5.04% |
| MAGYAR TELEKOM | 34,000 | 12,750,000 | Ft | 1.94% | GRAPHISOFT PARK SE | 130,995 | 121,825,350 | Ft | 8.51% |
| OTP | 3,000 | 12,450,000 | Ft | 1.90% | MAGYAR TELEKOM | 78,000 | 26,520,000 | Ft | 1.85% |
| RICHTER | 350 | 12,673,500 | Ft | 1.93% | RICHTER | 1,589 | 53,946,550 | Ft | 3.77% |
| FOTEX HOLDING TÖRZS | 36,665 | 5,874,081 | Ft | 0.90% | FOTEX HOLDING TÖRZS | 36,665 | 8,441,192 | Ft | 0.59% |
| Külföldi részvények (összes): | 498,958 | 211,718,010 | Ft | 32.29% | | 466,781 | 381,467,112 | Ft | 26.66% |
| ABLON | 72,208 | 3,977,610 | Ft | 0.61% | ADRIS GRUPA DD - PFD | 8,851 | 98,915,767 | Ft | 6.91% |
| ADRIS GRUPA DD - PFD | 5,000 | 47,658,650 | Ft | 7.27% | ALSTRIA OFFICE | 12,050 | 29,879,652 | Ft | 2.09% |
| ATRIUM EUROPEAN REALESTATE | 22,400 | 29,035,787 | Ft | 4.43% | ATRIUM EUROPEAN REALESTATE | 32,100 | 37,898,544 | Ft | 2.65% |
| CA IMMOBILIEN | 5,000 | 15,249,032 | Ft | 2.33% | CA IMMOBILIEN | 8,000 | 20,916,218 | Ft | 1.46% |
| FONDUL PROPRIETATEA | 385,000 | 13,901,443 | Ft | 2.12% | CEZ | 7,650 | 41,700,303 | Ft | 2.91% |
| PFIZER | 2,500 | 13,747,369 | Ft | 2.10% | FONDUL PROPRIETATEA | 385,000 | 15,808,277 | Ft | 1.10% |
| TELEKOM SLOVENIJE | 2,050 | 57,057,157 | Ft | 8.70% | LYXOR ETF RUSSIA MARKET VECTORS GOLD MINERS | 2,500 | 13,847,871 | Ft | 0.97% |
| VALERO ENERGY | 3,200 | 23,400,906 | Ft | 3.57% | MORGAN STANLEY CHINA A SHARES | 3,200 | 13,903,737 | Ft | 0.97% |
| ZAVAROVALNICA TRIGLAV | 1,600 | 7,690,056 | Ft | 1.17% | TELEKOM SLOVENIJE | 2,330 | 71,523,171 | Ft | 5.00% |
| | | | Ft | | ZAVAROVALNICA TRIGLAV | 1,600 | 8,406,157 | Ft | 0.59% |

| | | | | | | | | | |
|---------------------------------------|------------------|--------------------|-----------|----------------|--|----------------|----------------------|-----------|----------------|
| Tőzsdén kívüli (összes): | 0 | 0 | Ft | | | 0 | 0 | Ft | |
| Jelzáloglevelek (összes): | 0 | 0 | Ft | | | 0 | 0 | Ft | |
| Tőzsdére bevezetett (összes): | 0 | 0 | Ft | | | 0 | 0 | Ft | |
| Tőzsdén kívüli (összes): | 0 | 0 | Ft | | | 0 | 0 | Ft | |
| Befektetési jegyek (összes): | 0 | 0 | Ft | | | 0 | 0 | Ft | |
| Tőzsdére bevezetett (összes): | 0 | 0 | Ft | | | 0 | 0 | Ft | |
| Tőzsdén kívüli (összes): | 0 | 0 | Ft | | | 0 | 0 | Ft | |
| Kárpótlási jegy (összes): | 0 | 0 | Ft | | | 0 | 0 | Ft | |
| Aktív időbeli elhatárolások (összes): | 0 | 0 | Ft | | | 0 | 0 | Ft | |
| AIEH | | | 0 | Ft | | | | 0 | Ft |
| AIEH értékvesztése | | | 0 | Ft | | | | 0 | Ft |
| ESZKÖZÖK ÖSSZESEN: | 5,659,833 | 655,661,272 | Ft | 100.00% | | 988,631 | 1,431,107,887 | Ft | 100.00% |

Az Alap Nettó Eszközértékét a IV. pont tartalmazza.

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

575.562.093 db

III. Egy Befektetési jegyre eső Nettó eszközérték

2,443994

IV. Befektetési alap összetétele

| Befektetési Alap Összetétele | | | | |
|--|----------------|------------------|---------------|------------------|
| Megnevezés | Nyitó állomány | NAV százalékában | Záró állomány | NAV százalékában |
| Tőzsdén hivatalosan jegyzett értékpapírok | 500,914,102 | 74.82% | 1,083,315,967 | 77.01% |
| más szabályozott pacon forgalmazott átruházható értékpapírok | 104,181,236 | 15.56% | 213,854,326 | 15.20% |
| a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok | 0 | 0.00% | 0 | 0.00% |
| egyéb átruházható értékpapírok | 0 | 0.00% | 42,515,286 | 3.02% |
| hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok | 0 | 0.00% | 0 | 0.00% |
| Származtatott pozíciók értéke | -6,407,217 | -0.96% | 35,688,551 | 2.54% |
| Nettó eszközérték | 669,460,641 | 100.00% | 1,406,670,517 | 100.00% |

Az Alap befektetési politikájában, eszközeinek stratégiai összetételében jelentős változás nem történt.

Budapest, 2013. augusztus 28.

Hrehovszki Hedvig

back-office vezető

Concorde Alapkezelő zrt.

Mérész András

folyamatszervező

Concorde Alapkezelő zrt.