



PLATINA BÉTA SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP

Féléves jelentés

2017.

FÉLÉVES JELENTÉS

A Platina Béta Származtatott Befektetési Alap Féléves jelentése a 2014. évi XVI. törvény 6. számú melléklete alapján készült.

I. Vagyongkimutatás

	2016.12.31			2017.06.30		
	Piaci érték	Portfolió arányában	Nettó eszközérték arányában	Piaci érték	Portfolió arányában	Nettó eszközérték arányában
Átruházható értékpapírok	1,614,714,213	85.56%	85.61%	1,292,526,620	68.54%	68.77%
Accorde Első Román RA A Sor HUF	0	0.00%	0.00%	30,742,185	1.63%	1.64%
Accorde Omega Származtatott Befektetési Alap	99,491,742	5.27%	5.27%	97,320,914	5.16%	5.18%
Aegon Alfa Származtatott Alap	60,369,688	3.20%	3.20%	61,992,630	3.29%	3.30%
Agrokor 9.875% 2019/05/01	0	0.00%	0.00%	5,580,045	0.30%	0.30%
Biggeorge 5- A -Ingatlan Fejlesztési Ingatlan Befektetési Alap	60,547,646	3.21%	3.21%	59,211,845	3.14%	3.15%
Citadella Származtatott Befektetési Alap	40,700,751	2.16%	2.16%	40,651,449	2.16%	2.16%
Concorde Columbus Befektetési Alap	131,540,500	6.97%	6.97%	131,716,815	6.98%	7.01%
D170111	10,919,782	0.58%	0.58%	0	0.00%	0.00%
D170201	179,250,141	9.50%	9.50%	0	0.00%	0.00%
D170215	87,933,141	4.66%	4.66%	0	0.00%	0.00%
D170308	134,994,744	7.15%	7.16%	0	0.00%	0.00%
D170322	15,857,827	0.84%	0.84%	0	0.00%	0.00%
D170726	0	0.00%	0.00%	14,139,491	0.75%	0.75%
D170802	0	0.00%	0.00%	939,957	0.05%	0.05%
D170816	0	0.00%	0.00%	10,409,323	0.55%	0.55%
D170913	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
D171220	0	0.00%	0.00%	7,107,170	0.38%	0.38%
Duna House A Sorozat Törzs	28,214,500	1.50%	1.50%	27,657,500	1.47%	1.47%
Magyar Telekom	74,700,000	3.96%	3.96%	70,800,000	3.75%	3.77%
Marketprog Technics Abszolút Hozamú Származtatott Részalap	30,894,390	1.64%	1.64%	0	0.00%	0.00%
Masterplast Nyrt. Törzsrészvény	16,726,887	0.89%	0.89%	17,494,788	0.93%	0.93%
MOL 6.25% 2019/09/26	226,835,965	12.02%	12.03%	208,679,684	11.07%	11.10%
OTP - OPUSSE FLOAT PERP 2049/10/29	62,225,666	3.30%	3.30%	63,529,045	3.37%	3.38%
OTP Supra Származtatott Alap	109,322,229	5.79%	5.80%	114,707,354	6.08%	6.10%
OTPHB Float 2049/11/07	72,941,732	3.87%	3.87%	74,403,077	3.95%	3.96%
Platina PÍ Származtatott Alap A	139,125,918	7.37%	7.38%	140,680,777	7.46%	7.49%
Plotinus T	0	0.00%	0.00%	83,278,000	4.42%	4.43%
Wingholding 2019/I	32,120,964	1.70%	1.70%	31,484,571	1.67%	1.68%
Banki egyenlegek	20,487,492	1.09%	1.09%	57,140,262	3.03%	3.04%
EUR	7,448,643	0.39%	0.39%	9,027,748	0.48%	0.48%
GBP	4,133	0.00%	0.00%	30,205,322	1.60%	1.61%
HUF	110,124	0.01%	0.01%	34,111	0.00%	0.00%
USD	12,924,592	0.68%	0.69%	17,873,081	0.95%	0.95%
Követelések (ügyfélszámla)	27,087,426	1.44%	1.44%	11,650,609	0.62%	0.62%
HUF	9,980	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
USD	27,077,446	1.43%	1.44%	11,650,609	0.62%	0.62%
Egyéb eszközök	224,879,188	11.92%	11.92%	524,574,336	27.82%	27.91%
Összes eszköz	1,887,168,319	100.00%	100.06%	1,885,891,827	100.00%	100.34%
Kötelezettségek	1,056,348	0.06%	0.06%	6,412,794	0.34%	0.34%
Kötelezettségek értékpapír vásárlásból	0	0.00%	0.00%	5,125,267	0.27%	0.27%
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%
Sikerdíj	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%

Letétkezelési díj	113,245	0.01%	0.01%	109,690	0.01%	0.01%
Felügyeleti díj	0	0.00%	0.00%	118,000	0.01%	0.01%
Könyvelési díj	173,337	0.01%	0.01%	382,500	0.02%	0.02%
Könyvvizsgálati díj	609,600	0.03%	0.03%	508,000	0.03%	0.03%
Forgalomban tartási díj	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Bizományosi díj	9,200	0.00%	0.00%	21,337	0.00%	0.00%
Forgalmazói díj	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Bankköltség	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Befektetési alap különadója	150,966	0.01%	0.01%	148,000	0.01%	0.01%
Forgalmazási jutalék	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Borrowing cost	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
CFD Finance	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Corporate Actions	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Deviza váltás eredménye	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Forex eredmény	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Nettó eszközérték	1,886,111,971	99.94%	100.00%	1,879,479,034	99.66%	100.00%

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

608,451,200 db

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

3.088876

IV. Befektetési alap összetétele

Befektetési Alap Összetétele				
Megnevezés	Nyitó állomány (e Ft)	NAV százalékában (%)	Záró állomány (e Ft)	NAV százalékában (%)
Tőzsdén hivatalosan jegyzett értékpapírok	513,765,714	27.24%	577,326,665	30.72%
más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	0	0.00%	5,580,045	0.30%
a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
egyéb átruházható értékpapírok	671,992,864	35.63%	677,023,969	36.02%
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	650,350,107	34.49%	554,803,182	29.52%
Származtatott pozíciók értéke	2,973,370	0.16%	397,944	0.02%
Nettó eszközérték	1,885,838,340	100.00%	1,879,430,301	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

~ 200 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 benchmarkjának elmúlt 5 évbeli heti hozamadatai szolgáltak alapul. 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	2017.01.31	111
Platina Béta Származtatott Befektetési Alap	2017.02.28	111
Platina Béta Származtatott Befektetési Alap	2017.03.31	111
Platina Béta Származtatott Befektetési Alap	2017.04.28	111
Platina Béta Származtatott Befektetési Alap	2017.05.31	111
Platina Béta Származtatott Befektetési Alap	2017.06.30	110

A Fenti táblázat mutatja az ABA által alkalmazott tőkeáttétel mértékének változását a 2017 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, 2017. augusztus .

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.