

CONCORDE
A ALAPKEZELŐ

CONCORDE PB1 ALAPOK ALAPJA

Féléves jelentés

2017.

FÉLÉVES JELENTÉS

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

I. Vagyonkimutatás

	2016.12.31			2017.06.30		
	Piaci érték	Portfólió arányában	Nettó eszközérték arányában	Piaci érték	Portfólió arányában	Nettó eszközérték arányában
Átruházható értékpapírok	9,511,708,002	99.99%	100.42%	9,533,622,117	99.62%	100.33%
Carion Ing.Bef.Alap	80,953,838	0.85%	0.85%	83,919,766	0.88%	0.88%
Citadella Származtatott Befektetési Alap	249,899,614	2.63%	2.64%	0	0.00%	0.00%
Citadella Származtatott Befektetési Alap B	0	0.00%	0.00%	281,628,003	2.94%	2.96%
Concorde Columbus Befektetési Alap	384,846,725	4.05%	4.06%	474,565,276	4.96%	4.99%
Concorde Deep Turtle CL D1 - EUR	0	0.00%	0.00%	146,878,160	1.53%	1.55%
Concorde Hozamkereső Európai Származtatott Részvény Bef. A.	58,886,558	0.62%	0.62%	59,575,180	0.62%	0.63%
Concorde Konvergencia Részvény Alap	55,480,888	0.58%	0.59%	63,941,805	0.67%	0.67%
Concorde Közép-Európai Részvény Alap	22,288,083	0.23%	0.24%	8,521,377	0.09%	0.09%
Concorde Nemzetközi Részvény Alapok Alapja	60,485,043	0.64%	0.64%	59,712,875	0.62%	0.63%
Concorde PI Class C1 - Euro	0	0.00%	0.00%	147,343,765	1.54%	1.55%
Concorde Részvény Alap	147,417,882	1.55%	1.56%	150,849,021	1.58%	1.59%
Concorde Rövid Kötvény Alap	6,464,749,144	67.96%	68.25%	6,130,525,149	64.06%	64.52%
D170111	71,098,578	0.75%	0.75%	0	0.00%	0.00%
D170322	13,938,090	0.15%	0.15%	0	0.00%	0.00%
D170719	187,837,879	1.97%	1.98%	0	0.00%	0.00%
D170802	0	0.00%	0.00%	57,717,345	0.60%	0.61%
D170809	0	0.00%	0.00%	5,309,703	0.06%	0.06%
D170830	0	0.00%	0.00%	24,367,929	0.25%	0.26%
D170913	0	0.00%	0.00%	106,458,927	1.11%	1.12%
Mag Ing.Bef.Alap ZV	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
MÁK 2020/N	727,768,334	7.65%	7.68%	715,156,376	7.47%	7.53%
MÁK 2020/O	123,492,099	1.30%	1.30%	341,482,168	3.57%	3.59%
MÁK 2020/P	482,637,150	5.07%	5.10%	490,280,850	5.12%	5.16%
Nap Ing.Fejl.Alap A - Lejárt	0	0.00%	0.00%	572,995	0.01%	0.01%
Nap Ing.Fejl.Bef.Alap B - Lejárt	0	0.00%	0.00%	65,827	0.00%	0.00%
Platina Pí Származtatott Alap A	379,928,097	3.99%	4.01%	184,749,620	1.93%	1.94%
Banki egyenlegek	359,866	0.00%	0.00%	194,844	0.00%	0.00%
EUR	150,288	0.00%	0.00%	42,494	0.00%	0.00%
HUF	151,221	0.00%	0.00%	98,431	0.00%	0.00%
USD	58,357	0.00%	0.00%	53,919	0.00%	0.00%
Követelések (ügyfélszámla)	2	0.00%	0.00%	9,667	0.00%	0.00%
HUF		0.00%	0.00%	9,667	0.00%	0.00%
USD	2	0.00%	0.00%		0.00%	0.00%
Egyéb eszközök	723,939	0.01%	0.01%	35,750,227	0.37%	0.38%
Összes eszköz	9,512,791,809	100.00%	100.43%	9,569,576,855	100.00%	100.71%
Kötelezettségek	41,115,334	0.43%	0.43%	67,169,495	0.70%	0.71%
Kötelezettségek értékpapír vásárlásból	0	0.00%	0.00%	46,706,000	0.49%	0.49%
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	39,103,543	0.41%	0.41%	18,368,131	0.19%	0.19%
Letétkezelési díj	345,057	0.00%	0.00%	319,047	0.00%	0.00%
Felügyeleti díj	663,000	0.01%	0.01%	600,000	0.01%	0.01%
Könyvelési díj	173,337	0.00%	0.00%	382,500	0.00%	0.00%
Könyvvizsgálati díj	250,145	0.00%	0.00%	508,000	0.01%	0.01%
Forgalomban tartási díj	265,220	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Bizományosi díj	52,800	0.00%	0.00%	30,817	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	262,232	0.00%	0.00%	255,000	0.00%	0.00%
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	9,471,676,475	99.57%	100.00%	9,502,407,360	99.30%	100.00%

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

4,859,361,185 db

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

1.955528

IV. Befektetési alap összetétele

Befektetési Alap Összetétele				
Megnevezés	Nyitó állomány (e Ft)	NAV százalékában (%)	Záró állomány (e Ft)	NAV százalékában (%)
Tőzsdén hivatalosan jegyzett értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
egyéb átruházható értékpapírok	7,904,935,872	83.46%	7,792,848,819	82.01%
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	1,606,772,130	16.96%	1,740,773,298	18.32%
Származtatott pozíciók értéke	723,935	0.01%	-1,585,427	-0.02%
Nettó eszközérték	9,471,560,898	100.00%	9,502,618,364	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: 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=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 benchmarkjának elmúlt 5 évbéli 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 kitérttség (tőkeáttétel) mértéke (%)
Concorde PB1 Alapok Alapja	2017.01.31	100
Concorde PB1 Alapok Alapja	2017.02.28	100
Concorde PB1 Alapok Alapja	2017.03.31	100
Concorde PB1 Alapok Alapja	2017.04.28	100
Concorde PB1 Alapok Alapja	2017.05.31	100
Concorde PB1 Alapok Alapja	2017.06.30	100

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 200%.

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.