



CONCORDE EURO PÉNZPIACI BEFEKTETÉSI ALAP

Féléves jelentés

2017.

FÉLÉVES JELENTÉS

A Concorde Euro Pénzpiaci Befektetési Alap Féléves jelentése a 2014. évi XVI. törvény 6. számú melléklete alapján készült.

I. Vagyongkimutatás

	2016.12.31			2017.06.30		
	Piaci érték	Portfólió arányában	Nettó eszközérték arányában	Piaci érték	Portfólió arányában	Nettó eszközérték arányában
Átruházható értékpapírok	249,463,030	70.92%	71.09%	1,419,906	0.47%	0.48%
D170125	73,486,841	20.89%	20.94%	0	0.00%	0.00%
D170208	76,174,897	21.66%	21.71%	0	0.00%	0.00%
D170215	38,137,024	10.84%	10.87%	0	0.00%	0.00%
D170222	56,804,886	16.15%	16.19%	0	0.00%	0.00%
D170316	4,859,383	1.38%	1.38%	0	0.00%	0.00%
D170816	0	0.00%	0.00%	1,419,906	0.47%	0.48%
German Treasury Bill 2017/07/26	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Banki egyenlegek	90,586,860	25.75%	25.82%	284,225,973	94.81%	95.12%
EUR	90,443,658	25.71%	25.78%	283,994,762	94.73%	95.05%
HUF	143,202	0.04%	0.04%	231,211	0.08%	0.08%
Követelések (ügyfélszámla)	9,960	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
HUF	9,960	0.00%	0.00%		0.00%	0.00%
Egyéb eszközök	11,678,523	3.32%	3.33%	14,135,192	4.72%	4.73%
Összes eszköz	351,738,374	100.00%	100.24%	299,781,071	100.00%	100.33%
Kötelezettségek	845,583	0.24%	0.24%	983,726	0.33%	0.33%
Kötelezettségek értékpapír vásárlásból	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
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	141,013	0.04%	0.04%	47,415	0.02%	0.02%
Sikerdíj	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Letétkezelési díj	11,299	0.00%	0.00%	12,534	0.00%	0.00%
Felügyeleti díj	19,000	0.01%	0.01%	25,000	0.01%	0.01%
Könyvelési díj	173,337	0.05%	0.05%	382,500	0.13%	0.13%
Könyvvizsgálati díj	250,145	0.07%	0.07%	257,648	0.09%	0.09%
Forgalomban tartási díj	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Bizományosi díj	6,398	0.00%	0.00%	4,000	0.00%	0.00%
Forgalmazói díj	205,423	0.06%	0.06%	204,630	0.07%	0.07%
Bankköltség	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Befektetési alap különadója	38,968	0.01%	0.01%	50,000	0.02%	0.02%
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	350,892,791	99.76%	100.00%	298,797,345	99.67%	100.00%

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

97,460,503 db

III. Egy Befektetési jegyre eső Nettó eszközérték (befektetési jegy névértéke 0.01 EUR)

0.009928

IV. Befektetési alap összetétele

Befektetési Alap Összetétele				
Megnevezés	Nyitó állomány (EUR)	NAV százalékában (%)	Záró állomány (EUR)	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	0	0.00%	0	0.00%
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	847,612	75.17%	49,932	5.16%
Származtatott pozíciók értéke	-8,300	-0.74%	0	0.00%
Nettó eszközérték	1,127,635	100.00%	967,616	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: 1.

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 szolgálták 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 (%)
Concorde Euró Pénzpiaci Befektetési Alap	2017.01.31	100
Concorde Euró Pénzpiaci Befektetési Alap	2017.02.28	100
Concorde Euró Pénzpiaci Befektetési Alap	2017.03.31	100
Concorde Euró Pénzpiaci Befektetési Alap	2017.04.28	100
Concorde Euró Pénzpiaci Befektetési Alap	2017.05.31	100
Concorde Euró Pénzpiaci Befektetési Alap	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 25.

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.