

CONCORDE
 **ALAPKEZELŐ**

CONCORDE MOLTO FORTE HUF ALAPOKBA
FEKTETŐ RÉSZALAP „PVK” SOROZAT

Féléves jelentés

2017.

FÉLÉVES JELENTÉS

A Concorde Molto Forte HUF Alapokba Fektető Részalap „PVK” sorozatának 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	61,878,484	99.79%	99.95%	6,627,720,071	100.05%	100.34%
Citadella Származtatott Befektetési Alap B	0	0.00%	0.00%	24,295,039	0.37%	0.37%
Concorde Deep Turtle CL D1 - EUR	0	0.00%	0.00%	1,226,346,488	18.51%	18.57%
Concorde PI Class C1 - Euro	0	0.00%	0.00%	517,891,333	7.82%	7.84%
Concorde Rubicon Származtatott Alap	0	0.00%	0.00%	3,969,131,510	59.92%	60.09%
Concorde VM Class A1 - EUR	0	0.00%	0.00%	511,820,572	7.73%	7.75%
Concorde-VM Alap B	0	0.00%	0.00%	14,724,255	0.22%	0.22%
D170104	18,599,851	30.00%	30.04%	0	0.00%	0.00%
D170111	18,599,628	30.00%	30.04%	0	0.00%	0.00%
D170118	6,079,805	9.80%	9.82%	0	0.00%	0.00%
D170125	18,599,200	29.99%	30.04%	0	0.00%	0.00%
D170802	0	0.00%	0.00%	15,269,298	0.23%	0.23%
D170809	0	0.00%	0.00%	17,998,992	0.27%	0.27%
D170830	0	0.00%	0.00%	57,505,112	0.87%	0.87%
D170913	0	0.00%	0.00%	264,092,532	3.99%	4.00%
Platina Pí Származtatott Alap A	0	0.00%	0.00%	8,644,940	0.13%	0.13%
Banki egyenlegek	119,463	0.19%	0.19%	286,625	0.00%	0.00%
EUR		0.00%	0.00%	158,589	0.00%	0.00%
HUF	119,463	0.19%	0.19%	128,036	0.00%	0.00%
Követelések (ügyfélszámla)	9,880	0.02%	0.02%	0	0.00%	0.00%
HUF	9,880	0.02%	0.02%		0.00%	0.00%
Egyéb eszközök	0	0.00%	0.00%	-3,470,770	-0.05%	-0.05%
Összes eszköz	62,007,827	100.00%	100.15%	6,624,535,926	100.00%	100.29%
Kötelezettségek	95,455	0.15%	0.15%	19,155,138	0.29%	0.29%
Kötelezettségek értékpapír vásárlásból	0	0.00%	0.00%	14,254,996	0.22%	0.22%
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%	3,138,918	0.05%	0.05%
Sikerdíj	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Letétkezelési díj	1,870	0.00%	0.00%	269,724	0.00%	0.00%
Felügyeleti díj	1,000	0.00%	0.00%	394,000	0.01%	0.01%
Könyvelési díj	41,791	0.07%	0.07%	382,500	0.01%	0.01%
Könyvvizsgálati díj	34,942	0.06%	0.06%	381,000	0.01%	0.01%
Forgalomban tartási díj	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Bizományosi díj	14,000	0.02%	0.02%	28,000	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	1,852	0.00%	0.00%	306,000	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	61,912,372	99.85%	100.00%	6,605,380,788	99.71%	100.00%

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

6,620,691,346 db

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

0.997696

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	0	0.00%	6,272,854,137	94.96%
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	61,878,484	33.06%	354,865,934	5.37%
Származtatott pozíciók értéke	0	0.00%	-11,267,344	-0.17%
Nettó eszközérték	187,163,107	100.00%	6,605,439,823	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 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 (%)
Concorde MOLTO Forte HUF Alapokba Fektető Részalap „PVK” sorozat	2017.01.31	100
Concorde MOLTO Forte HUF Alapokba Fektető Részalap „PVK” sorozat	2017.02.28	100
Concorde MOLTO Forte HUF Alapokba Fektető Részalap „PVK” sorozat	2017.03.31	100
Concorde MOLTO Forte HUF Alapokba Fektető Részalap „PVK” sorozat	2017.04.28	100
Concorde MOLTO Forte HUF Alapokba Fektető Részalap „PVK” sorozat	2017.05.31	100
Concorde MOLTO Forte HUF Alapokba Fektető Részalap „PVK” sorozat	2017.06.30	100

A fenti táblázat mutatja az ABA által alkalmazott tőkeáttétel mértékének változását a 2017. június 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 alapan 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.