

CONCORDE
 **ALAPKEZELŐ**

CONCORDE MEZZO EUR ALAPOKBA FEKTETŐ
RÉSZALAP „PRÉM” SOROZAT

Féléves jelentés

2017.

FÉLÉVES JELENTÉS

A Concorde Mezzo EUR Alapokba Fektető Részalap „PRÉM” 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	55,828,874	56.84%	89.68%	69,849,347	90.49%	91.77%
Citadella Származtatott Befektetési Alap B	0	0.00%	0.00%	7,705,235	9.98%	10.12%
Concorde Columbus Befektetési Alap	14,147,703	14.40%	22.73%	13,191,322	17.09%	17.33%
Concorde Hozamkereső Európai Származtatott Részvény Bef. A.	1,412,821	1.44%	2.27%	2,064,212	2.67%	2.71%
Concorde Közép-Európai Részvény Alap	2,671,985	2.72%	4.29%	2,427,783	3.15%	3.19%
Concorde Nemzetközi Részvény Alapok Alapja	2,783,607	2.83%	4.47%	1,974,013	2.56%	2.59%
Concorde Részvény Alap	4,734,558	4.82%	7.61%	4,850,769	6.28%	6.37%
Concorde Rövid Kötvény Alap	16,914,894	17.22%	27.17%	7,649,681	9.91%	10.05%
Concorde-VM Alap B	0	0.00%	0.00%	8,046,440	10.42%	10.57%
D170125	19,999	0.02%	0.03%	0	0.00%	0.00%
D170712	0	0.00%	0.00%	199,996	0.26%	0.26%
D170726	0	0.00%	0.00%	2,079,924	2.69%	2.73%
MÁK 2020/N	0	0.00%	0.00%	4,902,786	6.35%	6.44%
Platina Pí Származtatott Alap A	13,143,307	13.38%	21.11%	13,218,774	17.13%	17.37%
Superposition Származtatott Befektetési Alap	0	0.00%	0.00%	1,538,410	1.99%	2.02%
Banki egyenlegek	42,205,737	42.97%	67.79%	7,162,779	9.28%	9.41%
EUR	42,205,737	42.97%	67.79%	7,085,286	9.18%	9.31%
HUF	0	0.00%	0.00%	77,492	0.10%	0.10%
Követelések (ügfélszámla)	1,530	0.00%	0.00%	8,435	0.01%	0.01%
HUF	1,530	0.00%	0.00%	8,435	0.01%	0.01%
Egyéb eszközök	182,544	0.19%	0.29%	167,123	0.22%	0.22%
Összes eszköz	98,218,685	100.00%	157.77%	77,187,685	100.00%	101.41%
Kötelezettségek	35,962,859	36.62%	57.77%	1,073,647	1.39%	1.41%
Kötelezettségek értékpapír vásárlásból	35,865,736	36.52%	57.61%	295,997	0.38%	0.39%
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	1,847	0.00%	0.00%	3,150	0.00%	0.00%
Felügyeleti díj	1,000	0.00%	0.00%	5,000	0.01%	0.01%
Könyvelési díj	41,791	0.04%	0.07%	382,500	0.50%	0.50%
Könyvvizsgálati díj	34,942	0.04%	0.06%	381,000	0.49%	0.50%
Forgalomban tartási díj	0	0.00%	0.00%	0	0.00%	0.00%
Bizományosi díj	16,000	0.02%	0.03%	4,000	0.01%	0.01%
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	1,543	0.00%	0.00%	2,000	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	62,255,826	63.38%	100.00%	76,114,037	98.61%	100.00%

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

24,670,442 db

III. Egy Befektetési jegyre eső Nettó eszközérték (befektetési jegy névértéke 0,01 EUR)

0.009990

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	179,439	89.86%	202,890	82.32%
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	64	0.03%	23,255	9.44%
Származtatott pozíciók értéke	294	0.15%	541	0.22%
Nettó eszközérték	199,684	100.00%	246,459	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 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 Mezzo EUR Alapokba Fektető Részalap „PRÉM” sorozat	2017.01.31	100
Concorde Mezzo EUR Alapokba Fektető Részalap „PRÉM” sorozat	2017.02.28	100
Concorde Mezzo EUR Alapokba Fektető Részalap „PRÉM” sorozat	2017.03.31	100
Concorde Mezzo EUR Alapokba Fektető Részalap „PRÉM” sorozat	2017.04.28	100
Concorde Mezzo EUR Alapokba Fektető Részalap „PRÉM” sorozat	2017.05.31	100
Concorde Mezzo EUR Alapokba Fektető Részalap „PRÉM” 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 alapban 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.