

privátvagyonkezelés
©|CONCORDE ALAPKEZELŐ

CONCORDE RUBICON SZÁRMAZTATOTT
BEFEKTETÉSI ALAP

Féléves jelentés

2014.

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

I. Vagyongkimutatás

Vagyongkimutatás										
	Tárgynap (T):	2013.12.31					2014.06.30			
I.	KÖTELEZETTSÉGEK		Összeg/Érték	Devi zan em	(%)			Összeg/Érték	Devi zan em	(%)
I/1.	Hitelállomány (összes):		0	Ft				0	Ft	
I/2.	Egyéb kötelezettségek (összes):		22,394,169	Ft	97.13%			74,301,272	Ft	99.13%
	Alapkezelői díj miatt		9,108,096	Ft	39.51%			11,453,855	Ft	15.28%
	Letétkezelői díj miatt		75,795	Ft	0.33%			91,527	Ft	0.12%
	Bizományosi díj miatt		22,249	Ft	0.10%			0	Ft	
	Forgalomban tartási díj		0	Ft				52,632	Ft	0.07%
	Reklám költség		100,257	Ft	0.43%			0	Ft	
	CFD Finance		0	Ft				0	Ft	
	Tranzakciós díj miatt		0	Ft				0	Ft	
	Sikerdíj miatt		0	Ft				0	Ft	
	Költségként elszámolt egyéb tétel (Felügyeleti díj)		113,000	Ft	0.49%			144,000	Ft	0.19%
	Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség		12,974,772	Ft	56.28%			62,559,258	Ft	83.46%
I/3.	Céltartalékok (összes):		0	Ft				0	Ft	
	Marketing		0	Ft				0	Ft	
I/4.	Passzív időbeli elhatárolások (összes):		660,969	Ft	2.87%			652,339	Ft	0.87%
	Könyvvizsgálat		457,835	Ft	1.99%			235,785	Ft	0.31%
	Könyvelés		157,222	Ft	0.68%			330,166	Ft	0.44%
	Hirdetési díj		0	Ft				0	Ft	
	Bankköltség		0	Ft				0	Ft	
	Transzfer érkeztetett ép bek.ért. elhatárolása		0	Ft				0	Ft	
	Borrowing coast		45,912	Ft	0.20%			84,460	Ft	0.11%
	Deviza konverzió			Ft				1,928	Ft	0.00%
	Kötelezettségek összesen:		23,055,138	Ft	100.00%			74,953,611	Ft	100.00%
II.	ESZKÖZÖK		Összeg/Érték	Devi zan em	(%)			Összeg/Érték	Devi zan em	(%)
II/1.	Folyószámla, készpénz (összes):		4,307,986	Ft	0.22%			151,919,876	Ft	6.15%
	Elszámolási betétszámla HUF		506,679	Ft	0.03%			967,634	Ft	0.04%
	Devizabetétszámla - EUR		2,669,456	Ft	0.14%			23,677,504	Ft	0.96%
	Devizabetétszámla - CZK		511	Ft	0.00%			533	Ft	0.00%
	Devizabetétszámla - GBP		440,138	Ft	0.02%			477,150	Ft	0.02%

CONCORDE RUBICON SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP
Éves jelentés (2013)

	Devizabetétszámla-HRK		175,750	Ft	0.01%			10,958,567	Ft	0.44%
	Devizabetétszámla-RON		193,558	Ft	0.01%			114,273,037	Ft	4.63%
	Devizabetétszámla-USD		321,894	Ft	0.02%			1,565,453	Ft	0.06%
II/2.	Egyéb követelés (összes):		134,823,502	Ft	7.04%			57,007,817	Ft	2.31%
	Devizapénzszámla-HUF		7,467	Ft	0.00%			0	Ft	0.00%
	Devizapénzszámla-USD		105,017,502	Ft	5.48%			20,291,056	Ft	0.82%
	Devizapénzszámla-EUR		7,520,784	Ft	0.39%			19,466,761	Ft	0.79%
	Követelések értékpapír eladásból		22,277,749	Ft	1.16%			17,250,000	Ft	0.70%
	Követelések értékpapír kölcsönadásból		0	Ft				0	Ft	
	Értékpapír kölcsönből származó követelések értékelési különbözete		0	Ft				0	Ft	
	Határidős ügyletek változó letét		0	Ft				0	Ft	
II/2.1.	Származtatott ügyletek értékelési különb		5,672,753	Ft	0.30%			237,659	Ft	0.01%
II/3.	Lekötött bankbetétek (összes):		0	Ft				0	Ft	
II/3.1.	Max. 3 hó lekötésű (összes):		0	Ft				0	Ft	
II/3.2.	3 hónapnál hosszabb lekötésű (összes):		0	Ft				0	Ft	
		Darabszám	Összeg/Érték	Devi zan em	(%)		Darabszám	Összeg/Érték	Devi zan em	(%)
II/4.	Értékpapírok (összes):	1,887,030	1,770,365,798	Ft	92.43%		7,617,725	2,251,192,219	Ft	91.20%
II/4.1.	Állampapírok (összes):	206,959	251,630,959	Ft	13.14%		6,032,704	412,381,671	Ft	16.71%
II/4.1.1.	Kötvények (összes):	0	0	Ft			0	0	Ft	
II/4.1.2.	Kincstárjegyek (összes):	20,959	220,466,461	Ft	11.51%		6,032,704	412,381,671	Ft	16.71%
	D140102	1,294	12,937,943	Ft	0.68%	D140716	4,072	40,679,687	Ft	1.65%
	D140108	4,110	41,073,902	Ft	2.14%	D140723	4,674	46,673,489	Ft	1.89%
	D140129	4,444	44,337,832	Ft	2.31%	D140730	317	3,164,120	Ft	0.13%
	D140305	7,559	75,207,590	Ft	3.93%	D140806	3,424	34,161,693	Ft	1.38%
	D140326	1,249	12,406,230	Ft	0.65%	D140827	12,694	126,485,555	Ft	5.12%
	D140402	1,303	12,936,223	Ft	0.68%	MNB140702	2,223	22,227,243	Ft	0.90%
	US TREASURY BILL 02/06/14	1,000	21,566,741	Ft	1.13%	GERMAN TREASURY BILL 07/16/2014	6,000,000	18,611,586	Ft	0.75%
				Ft		US TREASURY BILL 07/24/2014	5,300	120,378,298	Ft	4.88%
II/4.1.3.	Egyéb jegybankképes ép. (összes):	0	0	Ft			0	0	Ft	
				Ft					Ft	
II/4.1.4.	Külföldi állampapírok (összes):	186,000	31,164,498	Ft	1.63%		0	0	Ft	
	HELLENIC REP 2% 02/24/32	186,000	31,164,498	Ft	1.63%				Ft	
II/4.2.	Gazdálkodói és egyéb hitelviszonyt megtestesítő	1,527	536,364,036	Ft	28.00%		11,591	398,219,692	Ft	16.13%

CONCORDE RUBICON SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP

Éves jelentés (2013)

II/4.2.1.	Tőzsdére bevezetett (összes):	0	0	Ft		0	0	Ft	
II/4.2.2.	Külföldi kötvények (összes):	1,091	429,541,949	Ft	22.43%	11,155	267,719,142	Ft	10.85%
	MAGNOLIA FIN	6	169,285,374	Ft	8.84%	5	153,239,599	Ft	6.21%
	OTP - OPUS	975	226,376,424	Ft	11.82%	350	99,227,501	Ft	4.02%
	CETV 11.625 09/15/2016	110	33,880,151	Ft	1.77%	10,600	2,465,762	Ft	0.10%
				Ft		200	12,786,280	Ft	0.52%
		0		Ft				Ft	
II/4.2.3.	Tőzsdén kívüli (összes):	436	106,822,087	Ft	5.58%	436	130,500,550	Ft	5.29%
	OTPHB FLOAT 11/07/49	436	106,822,087	Ft		436	130,500,550	Ft	5.29%
II/4.3.	Részvények (összes):	1,678,544	982,370,803	Ft	51.29%	1,573,430	1,440,590,856	Ft	58.36%
II/4.3.1.	Tőzsdére bevezetett (összes):	647,879	419,036,895	Ft	21.88%	602,257	460,680,547	Ft	18.66%
	ÁLLAMI NYOMDA(98)	97,056	56,971,872	Ft	2.97%	68,496	50,687,040	Ft	2.05%
	DANUBIUS	12,939	66,182,985	Ft	3.46%	11,139	62,378,400	Ft	2.53%
	GRAPHISOFT PARK SE	151,687	173,074,867	Ft	9.04%	148,425	217,739,475	Ft	8.82%
	MAGYAR TELEKOM	386,074	121,227,236	Ft	6.33%	374,074	128,307,382	Ft	5.20%
	ÉMÁSZ RT	123	1,579,935	Ft	0.08%	123	1,568,250	Ft	0.06%
				Ft				Ft	
				Ft				Ft	
II/4.3.2.	Külföldi részvények (összes):	1,030,665	563,333,908	Ft	29.41%	971,173	979,910,309	Ft	39.70%
	ADRIS GRUPA DD - PFD	16,008	172,674,605	Ft	9.02%	17,520	198,780,518	Ft	8.05%
	ALSTRIA OFFICE	13,737	37,327,829	Ft	1.95%	16,137	48,413,544	Ft	1.96%
	ATRIUM EUROPEAN REALESTATE	37,900	47,037,076	Ft	2.46%	38,400	51,980,896	Ft	2.11%
	BANCA TRANSILVANIA	449,500	49,165,636	Ft	2.57%	573,555	72,615,906	Ft	2.94%
	CA IMMOBILIEN	9,450	36,138,698	Ft	1.89%	159,500	106,383,932	Ft	4.31%
	CENTRAL EUROPEAN MEDIA	23,000	19,047,974	Ft	0.99%	80,374	62,533,383	Ft	2.53%
	FONDUL PROPRIETATEA	429,046	23,705,956	Ft	1.24%	9,100	66,672,859	Ft	2.70%
	FOTEX HOLDING TÖRZS	36,665	8,926,688	Ft	0.47%	36,665	10,918,192	Ft	0.44%
	LEDO	160	51,276,192	Ft	2.68%	11,427	71,068,700	Ft	2.88%
	MARKET VECTORS GOLD MINERS	6,950	31,656,905	Ft	1.65%	227	82,286,592	Ft	3.33%
	MORGAN STANLEY CHINA A SHARES	3,780	19,410,688	Ft	1.01%	12,550	75,395,236	Ft	3.05%
	TELEKOM SLOVENIJE	1,069	38,579,580	Ft	2.01%	9,499	47,357,298	Ft	1.92%

	VIENNA INSURANCE GROUP	1,800	19,360,017	Ft	1.01%	TELEKOM SLOVENIJE	519	23,987,303	Ft	0.97%
	ZAVAROVALNICA TRIGLAV	1,600	9,026,064	Ft	0.47%	VIENNA INSURANCE GROUP	4,100	49,713,841	Ft	2.01%
				Ft		ZAVAROVALNICA TRIGLAV	1,600	11,802,109	Ft	0.48%
II/4.3.3.	Tőzsdén kívüli (összes):	0	0	Ft			0	0	Ft	
II/4.4.	Jelzáloglevelek (összes):	0	0	Ft			0	0	Ft	
II/4.4.1.	Tőzsdére bevezetett (összes):	0	0	Ft			0	0	Ft	
II/4.4.2.	Tőzsdén kívüli (összes):	0	0	Ft			0	0	Ft	
II/4.5.	Befektetési jegyek (összes):	0	0	Ft			0	0	Ft	
II/4.5.1.	Tőzsdére bevezetett (összes):	0	0	Ft			0	0	Ft	
II/4.5.2.	Tőzsdén kívüli (összes):	0	0	Ft			0	0	Ft	
II/4.6.	Kárpótlási jegy (összes):	0	0	Ft			0	0	Ft	
II/5.	Aktív időbeli elhatárolások (összes):	0	180,628	Ft	0.01%		0	8,133,922	Ft	0.33%
	AIEH		180,628	Ft	0.01%			8,133,922	Ft	0.33%
	AIEH értékvesztése		0	Ft				0	Ft	
	ESZKÖZÖK ÖSSZESEN:	1,887,030	1,915,350,667	Ft	100.00%		7,617,725	2,468,491,493	Ft	100.00%

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

776.125.578 db

III. Egy Befektetési jegyre eső Nettó eszközérték

3,083524

IV. Befektetési alap összetétele

Befektetési Alap Összetétele				
Megnevezés	Nyitó állomány (e Ft)	NAV százalékában (%)	Záró állomány (e Ft)	NAV százalékában (%)
Tőzsdén hivatalosan jegyzett értékpapírok	1,487,077,934	78.59%	1,763,415,312	73.68%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	251,630,959	13.30%	412,381,671	17.23%
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb átruházható értékpapírok	31,656,905	1.67%	75,395,236	3.15%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
Származtatott pozíciók értéke	5,672,748	0.30%	237,659	0.01%
Nettó eszközérték	1,892,289,499	100.00%	2,393,201,843	100.00%

Az Alap befektetési politikájában, eszközeinek stratégiai összetételében jelentős változás nem történt.

Budapest, 2014. július 30.

Hrehovszki Hedvig

Folyamatszervezési és termék menedzsment Igazgató
Concorde Alapkezelő zrt.

Mérész András

Folyamatszervező
Concorde Alapkezelő zrt.