

privátvagyonkezelés

©|CONCORDE ALAPKEZELŐ

PLATINA PÍ SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP

Féléves jelentés

2014.

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

I. Vagyonkimutatás

Vagyonkimutatás										
	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):		15,536,502,652	Ft	99.69%			877,410,244	Ft	99.94%
	Alapkezelői díj miatt		75,377,267	Ft	0.48%			159,483,415	Ft	18.17%
	Letétkezelői díj miatt		2,982,879	Ft	0.02%			4,259,097	Ft	0.49%
	Bizományosi díj miatt		42,876	Ft	0.00%			39,043	Ft	0.00%
	Forgalmazói költség miatt		21,315,743	Ft	0.14%			93,128,731	Ft	10.61%
	Közzétételi költség miatt		0	Ft					Ft	
	Reklám költség miatt		676,956	Ft	0.00%				Ft	
	Tranzakciós díj miatt		0	Ft					Ft	
	Sikerdíj miatt		513,905,996	Ft	3.30%			24,949,297	Ft	2.84%
	Költségként elszámolt egyéb tétel (PSZÁF díj)		2,754,000	Ft	0.02%			4,466,000	Ft	0.51%
	Forgalombantartási díj		0	Ft				494,661	Ft	0.06%
	Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség		14,919,446,935	Ft	95.73%			590,590,000	Ft	67.27%
I/3.	Céltartalékok (összes):		0	Ft				0	Ft	
	Marketing		0	Ft				0	Ft	
I/4.	Passzív időbeli elhatárolások (összes):		48,077,115	Ft	0.31%			550,597	Ft	0.06%
	Könyvvizsgálat		202,101	Ft	0.00%			208,164	Ft	0.02%
	Könyvelés		157,222	Ft	0.00%			330,166	Ft	0.04%
	Alapkezelési díj		15,744,327	Ft	0.10%			0	Ft	
	Bankköltség		0	Ft				0	Ft	
	Transzfer érkezett ép bek.ért. elhatárolása		0	Ft				0	Ft	
	Forgalmazási díj		29,262,428	Ft	0.19%			0	Ft	
	Deviza váltás eredménye			Ft					Ft	
	Borrowing coast		973,802	Ft	0.01%				Ft	
	CFD Finance		1,737,235	Ft	0.01%			12,267	Ft	0.00%
				Ft					Ft	
	Kötelezettségek összesen:		15,584,579,767	Ft	100.00%			877,960,842	Ft	100.00%
II.	ESZKÖZÖK		Összeg/Érték	Devi zan em	(%)			Összeg/Érték	Devi zan em	(%)
II/1.	Folyószámla készpénz (összes):		51,118,814	Ft	0.08%			7,504,733	Ft	0.01%
	Elszámolási betétszámla HUF		50,614,402	Ft	0.07%			166,916	Ft	0.00%
	Devizabetétszámla-USD		126,417	Ft	0.00%			712,125	Ft	0.00%
	Devizabetétszámla - EUR		360,033	Ft	0.00%			6,608,126	Ft	0.01%

PLATINA PÍ SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP
Féléves jelentés (2014)

	Devizabetétszámla-RON		3,479	Ft	0.00%			3,005	Ft	0.00%
	Devizabetétszámla-HKD		14,483	Ft	0.00%			14,561	Ft	0.00%
II/2.	Egyéb követelés (összes):		920,824,764	Ft	1.35%			16,482,327,546	Ft	22.28%
	Devizapénzszámla-HUF		-13	Ft	0.00%			7,883	Ft	0.00%
	Devizapénzszámla-USD		875,933,633	Ft	1.29%			1,529,665,528	Ft	2.07%
	Devizapénzszámla-EUR		44,891,144	Ft	0.07%			46,899,018	Ft	0.06%
	Követelések értékpapír eladásból		0	Ft				0	Ft	
	Követelések értékpapír kölcsönadásból		0	Ft				14,889,907,619	Ft	20.13%
	Értékpapír kölcsönből származó követelések értékelési különbözete		0	Ft				15,847,498	Ft	0.02%
	Határidős ügyletek változó letét		0	Ft				0	Ft	
II/2.1.	Származtatott ügyletek értékelési különb		-152,028,817	Ft	-0.22%			26,416,836	Ft	0.04%
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):	11,276,715	67,324,091,952	Ft	98.80%		10,155,249	57,455,680,126	Ft	77.67%
II/4.1.	Állampapírok (összes):	5,893,133	59,430,725,331	Ft	87.21%		4,704,213	46,884,172,401	Ft	63.38%
II/4.1.1.	Kötvények (összes):	2,632,731	26,389,804,151	Ft	38.73%		469,321	4,641,939,334	Ft	6.28%
	MÁK 2014/C	47,391	498,272,765	Ft	0.73%	MÁK 2015/B	87,150	872,822,937	Ft	1.18%
	MÁK 2015/B	87,150	863,419,452	Ft	1.27%	MÁK 2019/B	198,306	1,931,490,525	Ft	2.61%
	MÁK 2023/A	200,000	2,069,132,000	Ft	3.04%	MNB140709	183,865	1,837,625,872	Ft	2.48%
	MNB140108	797,909	7,974,023,278	Ft	11.70%				Ft	
	MNB140115	1,500,281	14,984,956,656	Ft	21.99%				Ft	
II/4.1.2.	Kincstárjegyek (összes):	3,260,402	33,040,921,180	Ft	48.49%		4,234,892	42,242,233,067	Ft	57.10%
	D140102	112,428	1,124,101,239	Ft	1.65%	D140702	2,140	21,397,346	Ft	0.03%
	D140108	1,047,717	10,470,516,997	Ft	15.37%	D140709	175	1,749,025	Ft	0.00%
	D140122	5,000	49,912,750	Ft	0.07%	D140716	105,824	1,057,192,342	Ft	1.43%
	D140129	214,233	2,137,404,783	Ft	3.14%	D140723	1,180,081	11,784,017,447	Ft	15.93%
	D140205	102,215	1,019,234,828	Ft	1.50%	D140730	200,237	1,998,655,604	Ft	2.70%
	D140212	16,498	164,418,408	Ft	0.24%	D140806	103,076	1,028,402,652	Ft	1.39%
	D140219	6,660	66,336,464	Ft	0.10%	D140813	1,013,959	10,112,030,594	Ft	13.67%
	D140226	10,000	99,549,200	Ft	0.15%	D140821	900,000	8,971,101,000	Ft	12.13%
	D140305	46,687	464,508,105	Ft	0.68%	D140827	46,191	460,256,362	Ft	0.62%
	D140326	19,131	190,026,884	Ft	0.28%	D140903	434,273	4,325,315,653	Ft	5.85%
	D140402	502,891	4,992,716,935	Ft	7.33%	D140917	121,966	1,213,720,256	Ft	1.64%
	D140409	1,000,000	9,926,730,000	Ft	14.57%	D141015	68,383	679,420,664	Ft	0.92%
	D140430	113,358	1,123,122,725	Ft	1.65%	D141126	1,287	12,754,131	Ft	0.02%
	D140625	13,584	134,004,802	Ft	0.20%	K150325	18,000	181,793,880	Ft	0.25%
	US TREASURY BILL 02/06/14	50,000	1,078,337,060	Ft	1.58%	K150408	4,300	43,366,661	Ft	0.06%
				Ft		K150527	35,000	351,059,450	Ft	0.47%

PLATINA PÍ SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP
Féléves jelentés (2014)

II/4.1.3.	Egyéb jegybankképes ép. (összes):	0	0	Ft		0	0	Ft	
II/4.1.4.	Külföldi állampapírok (összes):	0	0	Ft		0	0	Ft	
				Ft				Ft	
II/4.2.	Gazdálkodói és egyéb hitelviszonyt megtestesítő	19,320	4,556,202,911	Ft	6.69%	21,220	6,102,875,837	Ft	8.25%
II/4.2.1.	Tőzsdére bevezetett (összes):	0	0	Ft		0	0	Ft	
II/4.2.2.	Külföldi kötvények (összes):	0	0	Ft		0	0	Ft	
				Ft				Ft	
II/4.2.3.	Tőzsdén kívüli (összes):	19,320	4,556,202,911	Ft	6.69%	21,220	6,102,875,837	Ft	8.25%
	OTPHB FLOAT 11/07/49	5,495	1,346,301,308	Ft	1.98%	15,725	4,458,149,871	Ft	6.03%
	OTPHB FLOAT 2049/10/29 (2016/10/31)								
	OTPHB FLOAT 2049/11/07	13,825	3,209,901,603	Ft	4.71%	5,495	1,644,725,966	Ft	2.22%
II/4.3.	Részvények (összes):	5,364,262	3,337,163,710	Ft	4.90%	5,429,816	4,468,631,888	Ft	6.04%
II/4.3.1.	Tőzsdére bevezetett (összes):	5,364,262	3,337,163,710	Ft	4.90%	5,339,816	3,809,229,986	Ft	5.15%
	CIG	64,871	15,698,782	Ft	0.02%	257,878	76,791,530	Ft	0.10%
	FORRÁS OE	6,000	3,930,000	Ft	0.01%	279,322	409,765,374	Ft	0.55%
	GRAPHISOFT PARK SE	279,322	318,706,402	Ft	0.47%	4,557,389	1,563,184,427	Ft	2.11%
	MAGYAR TELEKOM	4,557,389	1,431,020,146	Ft	2.10%	141,454	1,711,593,400	Ft	2.31%
	MASTERPLAST NYRT. TÖRZSRÉSZVÉNY	97,773	42,629,028	Ft	0.06%	6,000	5,364,000	Ft	0.01%
	MOL RT	101,029	1,462,394,775	Ft	2.15%	97,773	42,531,255	Ft	0.06%
	FOTEX HOLDING TÖRZS	257,878	62,784,577	Ft	0.09%			Ft	
				Ft				Ft	
II/4.3.2.	Külföldi részvények (összes):	0	0	Ft		90,000	659,401,902	Ft	0.89%
				Ft		90,000	659,401,902	Ft	0.89%
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	0	Ft		0	2,187,738	Ft	0.00%
	AIEH			Ft			2,187,738	Ft	0.00%
	AIEH értékvesztése			Ft			0	Ft	
	ESZKÖZÖK ÖSSZESEN:	11,276,715	68,144,006,713	Ft	100.00%	10,155,249	73,974,116,979	Ft	100.00%

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

A sorozat: 5.165.856.109 db B sorozat: 14.980.283.492 db

III. Egy Befektetési jegyre eső Nettó eszközérték

A sorozat: 3,387343 B sorozat: 3,711217

IV. Befektetési alap összetétele

Befektetési Alap Összetétele				
Megnevezés	Nyitó állomány (e Ft)	NAV százalékában (%)	Záró állomány (e Ft)	NAV százalékában (%)
Tőzsdén hivatalosan jegyzett értékpapírok	7,864,841,844	14.98%	10,547,527,856	14.43%
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	59,430,725,331	113.18%	61,789,927,518	84.54%
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
Egyéb átruházható értékpapírok	-13,077,432	-0.02%	0	0.00%
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0	0.00%	0	0.00%
Származtatott pozíciók értéke	30,058,812	0.06%	77,086,045	0.11%
Nettó eszközérték A sorozat	13,574,670,681		17,498,526,530	
Nettó eszközérték B sorozat	38,934,668,231	100.00%	55,595,082,760	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.