



CITADELLA SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP
FÉLÉVES JELENTÉS
2013.

A Citadella Származtatott Befektetési Alap Féléves jelentése a 2011. Évi CXCVIII. törvény 6. számú melléklete alapján készült.

I. Vagyonkimutatás

Tárgnap (T):	Vagyonkimutatás							
	2012.12.31					2013.06.28		
KÖTELEZETTSÉGEK		Összeg/Érték	Devizanem	(%)		Összeg/Érték	Devizanem	(%)
Hitelállomány (összes):		0	Ft			0	Ft	
Egyéb kötelezettségek (összes):		56,414,830	Ft	89.06%		2,546,332,088	Ft	89.54%
Alapkezelői díj miatt		44,612,877	Ft	70.43%		55,827,438	Ft	1.96%
Letétkezelői díj miatt		731,767	Ft	1.16%		1,067,236	Ft	0.04%
Sikerdíj miatt		0	Ft				Ft	
Forgalmazói költség miatt		10,112,186	Ft	15.96%		24,568,825	Ft	0.86%
Közzétételi költség miatt		0	Ft				Ft	
Reklám költség miatt		0	Ft				Ft	
Tranzakciós díj miatt		17,000	Ft	0.03%		23,526	Ft	0.00%
Sikerdíj miatt		0	Ft			0	Ft	
Költségként elszámolt egyéb tétel (PSZÁF díj)		941,000	Ft	1.49%		1,244,000	Ft	0.04%
Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség		0	Ft			2,463,601,063	Ft	86.63%
Céltartalékok (összes):		0	Ft			0	Ft	
Marketing		0	Ft			0	Ft	
Passzív időbeli elhatárolások (összes):		6,930,329	Ft	10.94%		297,399,765	Ft	10.46%
Könyvvizsgálat		203,200	Ft	0.32%		209,550	Ft	0.01%
Könyvelés		148,744	Ft	0.23%		314,444	Ft	0.01%
Sikerdíj		0	Ft			296,875,771	Ft	10.44%
Bankköltség		0	Ft				Ft	
Transzfer érkeztetett ép bek.ért. elhatárolása		0	Ft				Ft	
Forgalmazói költség miatt		6,578,385	Ft	10.38%			Ft	
Kötelezettségek összesen:		63,345,159	Ft	100.00%		2,843,731,853	Ft	100.00%
ESZKÖZÖK		Összeg/Érték	Devizanem	(%)		Összeg/Érték	Devizanem	(%)
Folyószámla, készpénz (összes):		2,336,267	Ft	0.02%		7,670,132	Ft	0.03%
Elszámolási betétszámla HUF		138,339	Ft	0.00%		152,486	Ft	0.00%
Devizabetétszámla-USD		70,742	Ft	0.00%		42,891	Ft	0.00%
Devizabetétszámla - EUR		2,127,186	Ft	0.01%		7,474,756	Ft	0.03%
Egyéb követelés (összes):		935,439,104	Ft	6.52%		1,264,328,062	Ft	5.01%
Concorde Rt ügyfélszámla		7,209	Ft	0.00%		556	Ft	0.00%
Devizapénzszámla-USD		204,328,395	Ft	1.42%		207,633,977	Ft	0.82%
Devizapénzszámla-EUR		731,103,499	Ft	5.10%		1,056,693,529	Ft	4.18%
Devizapénzszámla-JPY		2	Ft	0.00%		0	Ft	
Követelések értékpapír eladásból		0	Ft			0	Ft	
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	
Származtatott ügyletek értékelési különb		127,330,072	Ft	0.89%		230,575,488	Ft	0.91%
Lekötött bankbetétek (összes):		0	Ft			0	Ft	

Max. 3 hó lekötésű (összes):		0	Ft				0	Ft	
3 hónapnál hosszabb lekötésű (összes):		0	Ft				0	Ft	
	Darabszám	Összeg/Érték	Devizanem	(%)		Darabszám	Összeg/Érték	Devizanem	(%)
Értékpapírok (összes):	329,838,431	13,275,450,042	Ft	92.57%		501,800,266	23,758,114,717	Ft	94.05%
Állampapírok (összes):	329,838,431	13,275,450,042	Ft	92.57%		501,800,116	19,170,128,492	Ft	75.89%
Kötvények (összes):	409,147	4,003,339,736	Ft	27.92%		409,147	4,043,231,569	Ft	16.01%
			Ft					Ft	
MÁK 2015/B	409,147	4,003,339,736	Ft	27.92%	MÁK 2015/B	409,147	4,043,231,569	Ft	16.01%
Kincstárjegyek (összes):	328,229,284	9,134,692,151	Ft	63.70%		501,390,969	15,126,896,923	Ft	59.88%
D130109	21	209,627	Ft	0.00%	D130703	33,798	337,783,972	Ft	1.34%
D130220	3,300	32,738,244	Ft	0.23%	D130710	29,754	297,126,122	Ft	1.18%
D130327	14,378	141,909,997	Ft	0.99%	D130807	1,418	14,114,446	Ft	0.06%
D130724	339,088	3,293,490,536	Ft	22.97%	D130904	50,555	501,589,521	Ft	1.99%
D130918	489,765	4,712,744,122	Ft	32.86%	D130911	18,825	186,624,838	Ft	0.74%
EFSF TREASURY BILL 06/17/2013	27,382,732	79,720,886	Ft	0.56%	D130918	581,427	5,759,435,620	Ft	22.80%
GERMAN TREASURY BILL 02/13/2013	300,000,000	873,878,739	Ft	6.09%	D131113	139,212	1,370,792,722	Ft	5.43%
			Ft		D140430	500,000	4,824,950,000	Ft	19.10%
			Ft		MNB130710	35,980	359,299,518	Ft	1.42%
			Ft		GERMAN TREASURY BILL 09/25/2013	500,000,000	1,475,180,164	Ft	5.84%
Egyéb jegybankképes ép. (összes):	0	0	Ft			0	0	Ft	
Külföldi állampapírok (összes):	1,200,000	137,418,155	Ft	0.96%		0	0	Ft	
HELLENIC REPUBLIC GGB 2% 02/24/32	1,200,000	137,418,155	Ft	0.96%				Ft	
Gazdálkodói és egyéb hitelviszonyt megtestesítő	0	0	Ft			150	4,587,986,225	Ft	18.16%
Tőzsdére bevezetett (összes):	0	0	Ft			150	4,587,986,225	Ft	18.16%
			Ft		MNV 2014/09/25 ÁTVÁLTHATÓ KÖTVÉNY	150	4,587,986,225	Ft	18.16%
Külföldi kötvények (összes):	0	0	Ft			0	0	Ft	
Tőzsdén kívüli (összes):	0	0	Ft			0	0	Ft	
Részvények (összes):	0	0	Ft			0	0	Ft	
Tőzsdére bevezetett (összes):	0	0	Ft			0	0	Ft	
Külföldi részvények (összes):	0	0	Ft			0	0	Ft	
Tőzsdén kívüli (összes):	0	0	Ft			0	0	Ft	
Jelzáloglevelek (összes):	0	0	Ft			0	0	Ft	
Tőzsdére bevezetett (összes):	0	0	Ft			0	0	Ft	
Tőzsdén kívüli (összes):	0	0	Ft			0	0	Ft	
Befektetési jegyek (összes):	0	0	Ft			0	0	Ft	
Tőzsdére bevezetett (összes):	0	0	Ft			0	0	Ft	
Tőzsdén kívüli (összes):	0	0	Ft			0	0	Ft	
Kárpótlási jegy (összes):	0	0	Ft			0	0	Ft	
KPJ			Ft					Ft	
Aktív időbeli elhatárolások (összes):	0	0	Ft			0	0	Ft	
AIEH			0	Ft				0	Ft
AIEH értékvesztése			0	Ft				0	Ft
ESZKÖZÖK ÖSSZESEN:	329,838,431	14,340,555,485	Ft	100.00%		501,800,266	25,260,688,400	Ft	100.00%

Az Alap Nettó Eszközértékét a IV. pont tartalmazza.

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

15.409.885.973 db

III. Egy Befektetési jegyre eső Nettó eszközérték

1,454722

IV. Befektetési alap összetétele

Befektetési Alap Összetétele				
Megnevezés	Nyitó állomány	NAV százalékában	Záró állomány	NAV százalékában
Tőzsdén hivatalosan jegyzett értékpapírok	0	0.00%	4,587,986,226	20.47%
más szabályozott pacon forgalmazott átruházható értékpapírok	13,311,567,428	91.57%	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	0	0.00%	0	0.00%
Származtatott pozíciók értéke	303,104,551	2.09%	63,055,735	0.28%
Nettó eszközérték	14,537,070,793	100.00%	22,417,096,217	100.00%

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

Budapest, 2013. augusztus 28.

Hrehovszki Hedvig

back-office vezető

Concorde Alapkezelő zrt.

Mérész András

folyamatszervező

Concorde Alapkezelő zrt.