

privátvagyonkezelés
©|CONCORDE ALAPKEZELŐ

CITADELLA SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI
ALAP

Féléves jelentés

2014.

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

I. Vagyongkimutatás

| Vagyongkimutatás | | | | | | | | | | |
|-------------------------|-----------------------------------------------------|------------|----------------------|-------------------|----------------|--|----------------------|-------------------|----------------|--|
| | Tárgy nap (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): | | 528,227,826 | Ft | 96.33% | | 142,009,950 | Ft | 99.60% | |
| | Alapkezelői díj miatt | | 68,824,076 | Ft | 12.55% | | 96,134,134 | Ft | 67.43% | |
| | Letétkezelői díj miatt | | 1,169,607 | Ft | 0.21% | | 1,376,580 | Ft | 0.97% | |
| | Sikerdíj miatt | | 298,596,161 | Ft | 54.45% | | 0 | Ft | | |
| | Forgalmazói költség miatt | | 11,669,196 | Ft | 2.13% | | 41,905,653 | Ft | 29.39% | |
| | Közzétételi költség miatt | | 0 | Ft | | | 0 | Ft | | |
| | Forgalomban tartási díj | | 0 | Ft | | | 548,383 | Ft | 0.38% | |
| | Tranzakciós díj miatt | | 14,200 | Ft | 0.00% | | 24,200 | Ft | 0.02% | |
| | Állományi díj | | 0 | Ft | | | 0 | Ft | | |
| | Költségként elszámolt egyéb tétel (Felügyeleti díj) | | 1,536,000 | Ft | 0.28% | | 2,021,000 | Ft | 1.42% | |
| | Egyéb - nem költség alapú - kötelezettség | | 146,418,586 | Ft | 26.70% | | 0 | Ft | | |
| I/3. | Céltartalékok (összes): | | 0 | Ft | | | 0 | Ft | | |
| | Marketing | | 0 | Ft | | | 0 | Ft | | |
| I/4. | Passzív időbeli elhatárolások (összes): | | 20,127,247 | Ft | 3.67% | | 565,951 | Ft | 0.40% | |
| | Könyvvizsgálat | | 209,550 | Ft | 0.04% | | 235,785 | Ft | 0.17% | |
| | Könyvelés | | 157,222 | Ft | 0.03% | | 330,166 | Ft | 0.23% | |
| | Sikerdíj | | 0 | Ft | | | 0 | Ft | | |
| | Bankköltség | | 0 | Ft | | | | Ft | | |
| | Transzfer érkeztetett ép bek.ért. elhatárolása | | 0 | Ft | | | | Ft | | |
| | Forgalmazói költség miatt | | 19,760,475 | Ft | 3.60% | | 0 | Ft | | |
| | Kötelezettségek összesen: | | 548,355,073 | Ft | 100.00% | | 142,575,901 | Ft | 100.00% | |
| II. | ESZKÖZÖK | | Összeg/Érték | Devi zan em | (%) | | Összeg/Érték | Devi zan em | (%) | |
| II/1. | Folyószámla, készpénz (összes): | | 790,105 | Ft | 0.00% | | 461,430 | Ft | 0.00% | |
| | Elszámolási betétszámla HUF | | 509,769 | Ft | 0.00% | | 168,210 | Ft | 0.00% | |
| | Devizabetétszámla-USD | | 40,902 | Ft | 0.00% | | 43,077 | Ft | 0.00% | |
| | Devizabetétszámla - EUR | | 239,434 | Ft | 0.00% | | 250,143 | Ft | 0.00% | |
| II/2. | Egyéb követelés (összes): | | 1,110,489,019 | Ft | 4.14% | | 3,480,388,425 | Ft | 11.90% | |
| | Devizapénzszámla-HUF | | 0 | Ft | | | 5,932 | Ft | 0.00% | |
| | Devizapénzszámla-USD | | 134,122,047 | Ft | 0.50% | | 308,682,635 | Ft | 1.06% | |
| | Devizapénzszámla-EUR | | 976,366,970 | Ft | 3.64% | | 46,516,806 | Ft | 0.16% | |

CITADELLA SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP
Féléves jelentés (2014)

| | | | | | | | | | | | | |
|------------------|-------------------------------------------------------------------|-------------------|-----------------------|--------------------|-----------------------|--------------|---------------|------------------------------------------|--------------------|-----------------------|-------------------|---------------|
| | Devizapénzszámla-JPY | | | 2 | Ft | 0.00% | | | | 0 | Ft | |
| | Követelések értékpapír eladásból | | | 0 | Ft | | | | | 0 | Ft | |
| | Követelések értékpapír kölcsönadásból | | | 0 | Ft | | | | | 3,116,573,299 | Ft | 10.66% |
| | Értékpapír kölcsönből származó követelések értékelési különbözete | | | 0 | Ft | | | | | 8,609,754 | Ft | 0.03% |
| | Határidős ügyletek változó letét | | | 0 | Ft | | | | | 0 | Ft | |
| II/2.1. | Származtatott ügyletek értékelési különb | | | 187,218,713 | Ft | 0.70% | | | | -5,549,663 | Ft | -0.02% |
| 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): | 502,418,48 | | 2 | 25,531,933,529 | Ft | 95.16% | | 602,409,917 | 25,771,363,066 | Ft | 88.11% |
| II/4.1. | Állampapírok (összes): | 502,418,48 | | 2 | 25,531,933,529 | Ft | 95.16% | | 602,409,917 | 25,771,363,066 | Ft | 88.11% |
| II/4.1.1. | Kötvények (összes): | 1,414,530 | 14,098,888,768 | | | Ft | 52.55% | | 770,203 | 7,537,533,198 | Ft | 25.77% |
| | MÁK 2015/B | 409,147 | 4,053,533,890 | | | Ft | 15.11% | MÁK 2015/B | 130,053 | 1,302,504,205 | Ft | 4.45% |
| | MNB140108 | 628,637 | 6,282,378,155 | | | Ft | 23.42% | MÁK 2019/B | 640,150 | 6,235,028,993 | Ft | 21.32% |
| | MNB140115 | 376,746 | 3,762,976,723 | | | Ft | 14.03% | | | | Ft | |
| II/4.1.2. | Kincstárjegyek (összes): | 501,003,95 | | 2 | 11,433,044,761 | Ft | 42.61% | | 601,639,714 | 18,233,829,868 | Ft | 62.34% |
| | D140102 | 14,642 | 146,396,719 | | | Ft | 0.55% | D140702 | 2,724 | 27,236,622 | Ft | 0.09% |
| | D140108 | 63,693 | 636,525,549 | | | Ft | 2.37% | D140716 | 90,386 | 902,965,179 | Ft | 3.09% |
| | D140129 | 9,240 | 92,187,572 | | | Ft | 0.34% | D140806 | 531,828 | 5,306,117,094 | Ft | 18.14% |
| | D140205 | 2,375 | 23,682,265 | | | Ft | 0.09% | D140827 | 7,577 | 75,498,743 | Ft | 0.26% |
| | D140219 | 6,971 | 69,434,158 | | | Ft | 0.26% | D140903 | 163,361 | 1,627,059,224 | Ft | 5.56% |
| | D140305 | 51,899 | 516,364,430 | | | Ft | 1.92% | MNB140702 | 26,460 | 264,567,190 | Ft | 0.90% |
| | D140326 | 18,019 | 178,981,466 | | | Ft | 0.67% | MNB140709 | 817,378 | 8,169,227,205 | Ft | 27.93% |
| | D140402 | 14,748 | 146,418,586 | | | Ft | 0.55% | GERMAN TREASURY BILL 07/16/2014 | 600,000,000 | 1,861,158,611 | Ft | 6.36% |
| | D140430 | 608,848 | 6,032,313,772 | | | Ft | 22.48% | | | | Ft | |
| | D140625 | 213,517 | 2,106,323,853 | | | Ft | 7.85% | | | | Ft | |
| | GERMAN TREASURY BILL 02/12/2014 | 500,000,000 | 1,484,416,391 | | | Ft | 5.53% | | | | Ft | |
| II/4.1.3. | Egyéb jegybankképes ép. (összes): | 0 | | 0 | | Ft | | | 0 | | Ft | |
| II/4.1.4. | Külföldi állampapírok (összes): | 0 | | 0 | | Ft | | | 0 | | Ft | |
| | | | | | | Ft | | | | | Ft | |
| II/4.2. | Gazdálkodói és egyéb hitelviszonyt megtestesítő | 0 | | 0 | | Ft | | | 0 | | Ft | |
| II/4.2.1. | Tőzsdére bevezetett (összes): | 0 | | 0 | | Ft | | | 0 | | Ft | |
| | | | | | | Ft | | | | | Ft | |
| II/4.2.2. | Külföldi kötvények (összes): | 0 | | 0 | | Ft | | | 0 | | Ft | |
| II/4.2.3. | Tőzsdén kívüli (összes): | 0 | | 0 | | Ft | | | 0 | | Ft | |
| II/4.3. | Részvények (összes): | 0 | | 0 | | Ft | | | 0 | | Ft | |
| II/4.3.1. | Tőzsdére bevezetett (összes): | 0 | | 0 | | Ft | | | 0 | | Ft | |

| | | | | | | | | | |
|-----------|---------------------------------------|-------------------|-----------------------|-----------|----------------|--------------------|-----------------------|-----------|----------------|
| II/4.3.2. | Külföldi részvények (összes): | 0 | 0 | Ft | | 0 | 0 | Ft | |
| 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 | |
| | KPJ | | | Ft | | | | Ft | |
| II/5. | Aktív időbeli elhatárolások (összes): | 0 | 0 | Ft | | 0 | 1,276,285 | Ft | 0.00% |
| | AIEH | | | Ft | | | 1,276,285 | Ft | 0.00% |
| | AIEH értékvesztése | | | Ft | | | 0 | Ft | |
| | | | | | | | | | |
| | ESZKÖZÖK ÖSSZESEN: | 502,418,48 | 26,830,431,367 | Ft | 100.00% | 602,409,917 | 29,247,939,544 | Ft | 100.00% |

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma

19.916.479.376 db

III. Egy Befektetési jegyre eső Nettó eszközérték

1,46136

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 | 25,531,933,529 | 97.15% | 28,896,546,118 | 99.28% |
| 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 | 67,642,167 | 0.26% | -5,549,663 | -0.02% |
| Nettó eszközérték | 26,282,068,031 | 100.00% | 29,105,145,004 | 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.