

Accorde Alapkezelő Zrt.

Accorde Prizma Befektetési Alap

2016. I. Féléves jelentés

(Időszak: 2016.02.17 - 2016.06.30.)

I. Vagyongkimutatás indulás: 02.17 Vége: 2016.06.30.

Instrumentum	Érték HUF-ban	Arány (%)
Banki egyenlegek		
<i>Deviza</i>		
Accorde Prizma Alap Erste változó letét EUR	28,240,676.00	0.69
Accorde Prizma Alap Erste változó letét GBP	57,492,000.00	1.41
Accorde Prizma Alap Erste változó letét USD	28,627,861.00	0.70
Accorde Prizma Alap UniCredit CHF	.00	0.00
Accorde Prizma Alap UniCredit EUR	1,453,962,523.00	35.60
Accorde Prizma Alap UniCredit GBP	37,774,072.00	0.92
Accorde Prizma Alap UniCredit HUF	247,729,120.00	6.07
Accorde Prizma Alap UniCredit RON	306,168,968.00	7.50
Accorde Prizma Alap UniCredit USD	230,207,518.00	5.64
Befektetési jegy jegyzési számla	.00	0.00
Pénz úton lévő	.00	0.00
<i>Deviza összesen</i>	<i>2,390,202,738.00</i>	<i>58.52</i>
Banki egyenlegek összesen	2,390,202,738.00	58.52
Kötelezettségek		
<i>Köv/Köt</i>		
Accorde Prizma Alap Befektetési jegy	-80,299,642.00	-1.97
D170316	190,000.00	0.00
DBX EU DEV RE ETF	-42,300,204.00	-1.04
<i>Köv/Köt összesen</i>	<i>-122,409,846.00</i>	<i>-3.00</i>
<i>Díjak</i>		
Alapkezelői díj	-16,693,275.66	-0.41
Felügyeleti díj	-260,834.00	-0.01
Könyvelési díj	-189,459.00	0.00
Könyvvizsgálói díj	-185,989.00	0.00
Különadó Unicredit	-524,530.00	-0.01
Letétkezelői díj	-272,824.00	-0.01
Sikerdíj	.00	0.00
<i>Díjak összesen</i>	<i>-18,126,911.66</i>	<i>-0.44</i>

Kötelezettségek összesen	-140,536,757.66	-3.44
Átruházható értékpapírok		
<i>Állampapír</i>		
D161228	69,708,730.00	1.71
D170316	596,094,600.00	14.60
D170524	297,523,500.00	7.28
GREECE 4.75% 2019/04/17	201,451,461.00	4.93
<i>Állampapír összesen</i>	<i>1,164,778,291.00</i>	<i>28.52</i>
<i>Részvény,ETF,Unit</i>		
AT&S AUSTRIA TECH&SYSTEMTECHN	65,194,623.00	1.60
BRD-GROUP SOCGEN	22,621,830.00	0.55
DB X-TRACKERS SHORTDAX ETF	82,574,668.00	2.02
DBX EU DEV RE ETF	43,440,383.00	1.06
ELECTRICA SA ORD	1,915,332.00	0.05
ERSTE BANK STAMMAKT	38,527,258.00	0.94
FONDUL PROPRIETATEA	20,313,480.00	0.50
GRAPHISOFT PARK SE	39,950,000.00	0.98
LYXOR MSCI GREECE	37,864,112.00	0.93
MAGYAR TELEKOM	26,760,000.00	0.66
ROMGAZ SA	37,748,518.00	0.92
<i>Részvény,ETF,Unit összesen</i>	<i>416,910,204.00</i>	<i>10.21</i>
<i>Vállalati kötvény</i>		
MOL 2.625% 2023/04/28	214,426,170.00	5.25
WINGHOLDING 2019/I	126,495,237.00	3.10
<i>Vállalati kötvény összesen</i>	<i>340,921,407.00</i>	<i>8.35</i>
Átruházható értékpapírok összesen	1,922,609,902.00	47.08
Egyéb eszközök		
<i>Határidős</i>		
<i>Határidős összesen</i>	<i>-88,134,278.47</i>	<i>-2.16</i>
Egyéb eszközök összesen	-88,134,278.47	-2.16
Eszközök összesen	4,224,678,361.53	103.44
Nettó eszközérték	4,084,141,606.34	100.00

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma az időszak elején és végén:

4,179,463,379 db

III. Egy jegyre jutó Nettó az időszak első és utolsó forgalmazási napján eszközérték (befektetési jegy névértéke 1 HUF):

0.977193

IV. Befektetési alap összetétele (nyitó állomány és záró állomány)

Befektetési alap összetétele					
Megnevezés	Nyitó állomány	NAV százalékában (%)	Záró állomány	NAV százalékában (%)	
Tőzsdén hivatalosan jegyzett értékpapírok	0	0	416,910,204	10.21	
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	0	0	0	0	
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	0	0	0	0	
Egyéb átruházható értékpapírok	0	0	0	0	
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0	0	1,505,699,698	36.87	
Banki egyenlegek	200,000,000	100.00	2,249,665,980	55.08	
Származtatott pozíciók értéke	0	0	-88,134,278	-2.16	
Nettó eszközérték	200,000,000	100.00	4,084,141,604	100.00	

Az Alap kockázati mutatója: 4.

A mutató az alap heti hozamainak ingadozását veszi alapul az elmúlt öt évre vonatkozóan. Az alap 2016 -ban indult.

A kockázati besorolást az alap által megcélzott referenciaindex múltbeli hozamaiból vagy az alap által megcélzott piaci szegmenst tükröző portfólió múltbeli hozamaiból számított szórás érték alapján szám- szerűsítettük, a múltbeli adatok azonban nem szükségszerűen megbízható mutatói a jövőbeli kockázati profilnak.

A feltüntetett kockázat/nyereség profil nem marad garantáltan változatlan, és az Alap kategorizálása idővel módosulhat.

A legalacsonyabb kategória nem jelent kockázatmentes befektetést.

Alap neve	Dátum	Nettó összesített kockázati kitettség mértéke (%)
<i>Accorde Prizma Származtatott Alap</i>	2016.02.29	100.00
<i>Accorde Prizma Származtatott Alap</i>	2016.03.31	100.00
<i>Accorde Prizma Származtatott Alap</i>	2016.04.29	100.00
<i>Accorde Prizma Származtatott Alap</i>	2016.05.31	100.00
<i>Accorde Prizma Származtatott Alap</i>	2016.06.30	112.94

A fenti táblázat mutatja az ABA által alkalmazott tőkeáttétel mértékének változását a 2016 június hó végi állapota alapján.

Az Alap kezelési szabályzata alapján, az alap által felvehető maximális mértékű tőkeáttétel fedezetére az alapon lévő rövid lejáratú likvid állampapírok szolgálnak.

Budapest, 2016. augusztus 17.

Gyurcsik Attia
Befektetési igazgató

Mezei Magdolna
Ügyvezető igazgató

Jelen dokumentum saját kezű aláírásképet biztonsági okból nem tartalmaz. Jelen dokumentum tartalma az eredeti, cégszerű aláírással és egyéb felelős személy aláírásával ellátott papír alapú dokumentum tartalmával mindenben egyező és sajátkezű aláírás nélkül is cégszerűnek illetve hitelesnek tekinthető.