



Accorde Alapkezelő Zrt.

Aforizma Származtatott Részalap
2021. I. Féléves jelentés

(Időszak: 2020.12.31 - 2021.06.30.)

I. Vagyonkimutatás indulás: 2020.12.31. Vége: 2021.06.30.

Instrumentum	Érték HUF-ban	Arány (%)	Érték HUF-ban	Arány (%)
Banki egyenlegek	2020.12.31		2021.06.30	
<i>Deviza</i>				
Aforizma Alap UniCredit HUF	153,570,105	13.49	43,715,474	3.31
Aforizma Alap UniCredit PLN	1,831	0.00	369	0.00
Aforizma Alap UniCredit RON	0	0.00	9,807	0.00
Aforizma SAXO HUF 8516151	120,307,753	10.57	100,171,188	7.58
<i>Deviza összesen</i>	<i>273,879,689</i>	<i>24.06</i>	<i>143,896,838</i>	<i>10.90</i>
Banki egyenlegek összesen	273,879,689	24.06	143,896,838	10.90
Átruházható értékpapírok				
<i>Állampapír</i>				
D210421	332,231,008	29.18	0	0.00
D210630	28,065,418	2.47	0	0.00
D210825	50,244,769	4.41	50,314,755	3.81
D211020	100,187,594	8.80	100,300,589	7.59
D220309	0	0.00	329,838,381	24.97
D220504	0	0.00	28,006,471	2.12
<i>Állampapír összesen</i>	<i>510,728,789</i>	<i>44.86</i>	<i>508,460,196</i>	<i>38.50</i>
<i>Részvény,ETF,Unit</i>				
Biggeorge 14.Ingfejl. Ingbef. Alap 'A' sorozat befektetési jegy	47,469,345	4.17	0	0.00
Biggeorge 16.Ingfejl. Ingbef. Alap 'A' sorozat befektetési jegy	39,612,967	3.48	0	0.00
Duna House Részvény	61,593,214	5.41	120,337,152	9.11
Magyar Telekom	59,685,460	5.24	128,100,000	9.70
Masterplast Nyrt.	69,300,000	6.09	3,940,000	0.30
MOL Nyrt.	0	0.00	141,480,000	10.71
Richter Gedeon Nyrt	0	0.00	78,900,000	5.97
Wobegon Részalap Bef.jegy	0	0.00	83,821,524	6.35
<i>Részvény,ETF,Unit összesen</i>	<i>277,660,986</i>	<i>24.39</i>	<i>556,578,676</i>	<i>42.14</i>
<i>Vállalati kötvény</i>				
PCRK 2024/A	0	0.00	105,656,778	8.00
<i>Vállalati kötvény összesen</i>	<i>0</i>	<i>0.00</i>	<i>105,656,778</i>	<i>8.00</i>
Átruházható értékpapírok összesen	788,389,775	69.25	1,170,695,650	88.64
Követelések				
<i>Köv/Köt</i>				
D210421	1,244,097	0.11	0	0.00
D210630	103,682	0.01	0	0.00
D210825	106,860	0.01	354,830	0.03

D211020	95,000	0.01	488,364	0.04
D220309	0	0.00	512,321	0.04
D220504	0	0.00	95,000	0.01
MAGYAR FORINT	420,824	0.04	-12,177	0.00
Wobegon Részalap Bef.jegy	0	0.00	7,990,504	0.61
Masterplast Nyrt.	74,126,416	6.51	0	0.00
Követelések összesen	76,096,879	6.68	9,428,842	0.71
Egyéb eszközök				
CFD	1,063,625	0.09	0	0.00
CFD Összesen	1,063,625.00	0.09	0.00	0.00
Határidős	0	0.00	-2,519,300	-0.19
Határidős összesen	0.00	0.00	-2,519,300.40	-0.19
Egyéb eszközök összesen	1,063,625	0.09	-2,519,300	-0.19
Eszközök összesen	1,062,304,956	93.32	1,311,256,729	99.29
Kötelezettségek				
Díjak				
Felügyeleti díj	-96,194	-0.01	-112,440	-0.01
Könyvelési díj	-191,541	-0.02	-189,978	-0.01
Könyvvizsgálói díj	-538,937	-0.05	-275,271	-0.02
Különadó	-125,905	-0.01	-152,978	-0.01
Letétkezelői díj	-75,556	-0.01	-85,792	-0.01
Díjak összesen	-1,028,133	-0.09	-816,459	-0.06
Kötelezettségek összesen	-1,028,133	-0.09	-816,459	-0.06
Nettó eszközérték	1,138,401,835	100	1,320,685,571	100

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

	2020.12.31	2021.06.30
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db)	891,151,064	891,151,064

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

	2020.12.31	2021.06.30
Egy jegyre jutó nettó eszközérték (HUF)	1.277451	1.482000

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

Megnevezés	Befektetési alap eszközállományának összetétele			
	Nyitó állomány	(%)	Záró állomány	(%)
Tőzsdén hivatalosan jegyzett értékpapírok	190,578,674	24.17	472,757,152	40.38
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	0	0.00	0	0.00
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	0	0.00	0	0.00
Egyéb átruházható értékpapírok	87,082,312	11.05	83,821,524	7.16
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	510,728,789	64.78	614,116,974	52.46
Értékpapírok összesen	788,389,775	100.00	1,170,695,650	100.00

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

V. Az ABA féléves beszámolójában nyújtandó információ az értékpapír kölcsön ügyletekről

Globális adatok

Kölcsönbe adott értékpapírok	ISIN	Ügylet kezdete	Ügylet vége	Ügylet értéke	Kölcsönözhető eszközállomány arányában (%)	Nettó eszközérték arányában (%)
D210825	HU0000523253	2020.10.15	2021.08.19	50,350,000	100.00	3.81
D211020	HU0000523329	2020.12.15	2021.10.14	100,440,000	100.00	7.61
D220309	HU0000523469	2021.04.15	2022.03.03	50,350,000	15.20	3.81
D220309	HU0000523469	2021.04.15	2022.03.03	79,600,000	24.02	6.03
D220309	HU0000523469	2021.04.15	2022.03.03	201,400,000	60.78	15.25
D220504	HU0000523626	2021.06.24	2022.04.28	28,110,000	100.00	2.13
Összesen				510,250,000		38.64

Koncentrációra vonatkozó adatok

- A tíz legnagyobb biztosítékkibocsátó:

Biztosítékkibocsátó neve	Eszköz neve	Darabszám
Biggeorge Alapkezelő Zrt.	Biggeorge 12.Ingfejl. Ingbef. Alap 'A' sorozat	20,000,000
Concorde Értékpapír Zrt.	Concorde Értékpapír Zrt.Elsobbiségi Törzsrészvény	135,000
Accorde Alapkezelő Zrt.	Accorde Spartan Görög Részvényalap 'A' sorozat	29,725,885
	Accorde Omega Származtatott Részalap	67,710,642
	Accorde Selection Részvényalap 'A' sorozat	78,140,000
	Accorde Prizma Alap 'A' sorozat	460,500,000
OTP Alapkezelő Zrt.	OTP Supra Származtatott Befektetési Alap	8,000,000

- A tíz legfontosabb szerződő fél:

Szerződő fél	Kölcsönbe adott értékpapírok	ISIN	Ügylet kezdete	Ügylet vége	Ügylet értéke
1. ügyfél	D210825	HU0000523253	2020.10.15	2021.08.19	50,350,000
2. ügyfél	D211020	HU0000523329	2020.12.15	2021.10.14	100,440,000
3. ügyfél	D220309	HU0000523469	2021.04.15	2022.03.03	50,350,000
4. ügyfél	D220309	HU0000523469	2021.04.15	2022.03.03	79,600,000
5. ügyfél	D220309	HU0000523469	2021.04.15	2022.03.03	201,400,000
6. ügyfél	D220504	HU0000523626	2021.06.24	2022.04.28	28,110,000

Az értékpapírtitokra és adatvédelemre vonatkozó szabályozást figyelembe véve a szerződő felek személyét nem fedhetjük fel, őket számozott ügyfélként jelöljük. Minden szám külön ügyletet jelöl.

Biztosítékokra vonatkozó adatok

Biztosíték típusa	Lejáratil profil		
	Nylitott lejáratú		
Biztosíték pénzneme	HUF	EUR	USD
Kollektív befektetési formák	644,211,527	252,340	0

A kapott biztosítékok letéti őrzése

Letétkezelő neve	Őrzött biztosítékok összege (HUF)
Concorde Értékpapír Zrt.	733,009,973

Értékpapír kölcsönökre vonatkozó adatok

Kölcsönbe adott értékpapírok	Lejáratil profil	
	90 nap alatt (HUF)	91 – 365 nap (HUF)
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	50,350,000	459,900,000

Az értékpapír kölcsönzési ügyletek hozamára és költségeire vonatkozó adatok

Kölcsönbe adott értékpapírok	ISIN	Ügylet kezdete	Ügylet vége	Ügylet lejáratkori teljes díja (HUF)	Eddig felszámolt díj (HUF)	Eddig felszámolt díj (%)
D210825	HU0000523253	2020.10.15	2021.08.19	421,960	353,460	83.77
D211020	HU0000523329	2020.12.15	2021.10.14	747,345	404,470	54.12
D220309	HU0000523469	2021.04.15	2022.03.03	308,953	72,921	23.60
D220309	HU0000523469	2021.04.15	2022.03.03	488,435	115,283	23.60
D220309	HU0000523469	2021.04.15	2022.03.03	1,235,814	291,683	23.60
D220504	HU0000523626	2021.06.24	2022.04.28	235,433	4,586	1.95

VI. Kockázati profil

Az Alap kockázati mutatója mutatója: 4.

A mutató az alap heti hozamainak ingadozását veszi alapul. Az alap 2018 -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 számszerűsítettük, 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 kitétség mértéke (%)
<i>Aforizma Származtatott Részalap</i>	2021.01.29	100.00
<i>Aforizma Származtatott Részalap</i>	2021.02.26	101.78
<i>Aforizma Származtatott Részalap</i>	2021.03.31	114.73
<i>Aforizma Származtatott Részalap</i>	2021.04.30	135.75
<i>Aforizma Származtatott Részalap</i>	2021.05.31	132.92
<i>Aforizma Származtatott Részalap</i>	2021.06.30	133.65

A fenti táblázat mutatja az ABA által alkalmazott tőkeáttétel mértékének változását a 2021. június hó végi állapota alapján.

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



Budapest, 2021. augusztus 31.

Gyurcsik Attila
Vezérigazgató

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.