

# Accorde Alapkezelő Zrt.

Accorde Sharp Származtatott Részalap  
2023. I. Féléves jelentés

(Időszak: 2022.12.31 - 2023.06.30.)

I. Vagyonkimutatás indulás: 2022.12.31.

<b>Instrumentum</b>	<b>Érték HUF-ban</b>	<b>Arány (%)</b>
<b>Banki egyenlegek</b>	<b>2022.12.31</b>	
<i>Deviza</i>		
Accorde Sharp Részalap SAXO EUR 7966280	142,682,948	2.68%
Accorde Sharp Részalap SAXO USD 7966280	256,829,549	4.82%
Accorde Sharp Részalap UniCredit EUR	2,019,222,807	37.92%
Accorde Sharp Részalap UniCredit HUF	554,910,638	10.42%
Accorde Sharp Részalap UniCredit PLN	2,011	0.00%
Accorde Sharp Részalap UniCredit RON	113,619	0.00%
Accorde Sharp Részalap UniCredit USD	169,520	0.00%
<i>Deviza összesen</i>	<b>2,973,931,092</b>	<b>55.84%</b>
<i>Betét</i>		
MAGYAR FORINT	0	0.00%
<i>Betét összesen</i>	0	0.00%
<b>Banki egyenlegek összesen</b>	<b>2,973,931,092</b>	<b>55.84%</b>
<b>Átruházható értékpapírok</b>		
<i>Állampapír</i>		
D230419	96,449	0.00%
MÁK 2051/G	172,349,460	3.24%
<i>Állampapír összesen</i>	<b>172,445,909</b>	<b>3.24%</b>
<i>Részvény,ETF,Unit</i>		
Adventum SATIS EUR Zártkörű Alapok Alapja	431,568,429	8.10%
Eurobank Holdings SA	295,584,624	5.55%
OMV PETROM	229,294,800	4.31%
<i>Részvény,ETF,Unit összesen</i>	<b>956,447,853</b>	<b>17.96%</b>
<i>Vállalati kötvény</i>		
CESSPO 2025/11/14	165,474,237	3.11%
EIB 11.5 2025/09609	205,543,600	3.86%
OTPHB 7.35% Float 2026/03/04	120,159,053	2.26%
OTPHB Float 2025/07/13	401,913,439	7.55%
Raiffeisen Bank HU Float 2025/11/12	207,569,650	3.90%
<i>Vállalati kötvény összesen</i>	<b>1,100,659,979</b>	<b>20.67%</b>
<i>CFD</i>		
<i>CFD Összesen</i>	0	0.00%
<i>Opció</i>		
<i>Opció összesen</i>	0	0.00%
<b>Átruházható értékpapírok összesen</b>	<b>2,229,553,741</b>	<b>41.87%</b>
<b>Követelések</b>		
<i>Köv/Köt</i>		
USA DOLLÁR	2,478,496	0.05%
<i>Értékpapír</i>	24,703,846	0.46%
<b>Követelések összesen</b>	<b>27,182,342</b>	<b>0.51%</b>
<b>Egyéb eszközök</b>		
Bank kamat	57,519,904	1.08%
Kölcsönzési díj	162,941	0.00%
Határidős	87,271,357	1.64%
<i>Határidős összesen</i>	<b>87,271,357</b>	<b>1.64%</b>
IRS	-20,365,154	-0.38%
<i>IRS összesen</i>	<b>-20,365,154</b>	<b>-0.38%</b>

<b>Egyéb eszközök összesen</b>	<b>124,589,048</b>	<b>2.34%</b>
<b>Eszközök összesen</b>	<b>5,355,256,224</b>	<b>100.56%</b>
<b>Kötelezettségek</b>		
<i>Díjak</i>		
Alapkezelői díj 'A'	-22,704,109	-0.43%
Alapkezelői díj 'B'	-1,846,023	-0.03%
Alapkezelői díj 'I'	-241,029	0.00%
Elemzési és kutatási díj BCA	-1,420,262	-0.03%
Felügyeleti díj	-489,418	-0.01%
Könyvelési díj	-189,978	0.00%
Könyvvizsgálói díj	-652,258	-0.01%
Különadó	-639,610	-0.01%
Letétkezelői díj	-327,788	-0.01%
<i>Díjak összesen</i>	<b>-28,510,475</b>	<b>-0.54%</b>
<i>Köv/Köt</i>		
Bank költség	-2,000	0.00%
EURO	-59,465	0.00%
USA DOLLÁR	-1,170,186	-0.02%
<b>Kötelezettségek összesen</b>	<b>-29,742,126</b>	<b>-0.56%</b>
<b>Nettó eszközérték</b>	<b>5,325,514,098</b>	<b>100.00%</b>

Vége: 2023.06.30.

<b>Instrumentum</b>	<b>Érték HUF-ban</b>	<b>Arány (%)</b>
<b>Banki egyenlegek</b>	<b>2023.06.30</b>	
<i>Deviza</i>		
Accorde Sharp Részalap Concorde Margin HUF	-322,480,000	-6.57
Accorde Sharp Részalap SAXO EUR 7966280	42,964,432	0.88
Accorde Sharp Részalap SAXO USD 7966280	172,180,010	3.51
Accorde Sharp Részalap UniCredit EUR	293,568,937	5.98
Accorde Sharp Részalap UniCredit HUF	218,172,669	4.45
Accorde Sharp Részalap UniCredit PLN	2,057	0.00
Accorde Sharp Részalap UniCredit RON	326,973	0.01
Accorde Sharp Részalap UniCredit USD	406,840	0.01
<i>Deviza összesen</i>	<b>405,141,918</b>	<b>8.25</b>
<i>Betét</i>		
EURO	519,676,102	10.59
<i>Betét összesen</i>	<b>519,676,102</b>	<b>10.59</b>
<b>Banki egyenlegek összesen</b>	<b>924,818,020</b>	<b>18.84</b>
<b>Átruházható értékpapírok</b>		
<i>Állampapír</i>		
D240221	26,308,800	0.54
MÁK 2026/E	305,510,110	6.22
ROMANI 2.75 04/14/2041	346,529,277	7.06
<i>Állampapír összesen</i>	<b>678,348,187</b>	<b>13.82</b>

<i>Részvény,ETF,Unit</i>		
Adventum SATIS EUR Zártkörű Alapok Alapja	397,565,355	8.10
Eurobank Holdings SA	280,017,586	5.71
Piraeus Financial Holding SA	267,748,028	5.46
UniCredit SpA	315,683,178	6.43
<i>Részvény,ETF,Unit összesen</i>	<i>1,261,014,147</i>	<i>25.69</i>
<i>Vállalati kötvény</i>		
Banca Comerciala Romana 7.625 05/19/27	114,968,651	2.34
BANCA TRANSILVANIA 8.875 2027/04/27	465,080,372	9.48
EIB 11.5 2025/09/09	228,760,000	4.66
ETEGA 8.25% 2029/07/18	160,110,232	3.26
KERPW 6.5 2024/10/17	51,746,296	1.05
NOVALJ 10.75 2032/11/28	210,344,793	4.29
Raiffeisen Bank HU Float 2025/11/22 (RABHUG)	201,338,025	4.10
Raiffeisen Bank 7.875 2027/06/05 (RABCRO)	38,136,168	0.78
Raiffeisen Bank EUR Float 2026/01/19 (RABKAS)	190,985,910	3.89
<i>Vállalati kötvény összesen</i>	<i>1,661,470,447</i>	<i>33.85</i>
<b>Átruházható értékpapírok összesen</b>	<b>3,600,832,781</b>	<b>73.37</b>
<b>Követelések</b>		
<i>Köv/Köt</i>		
Accorde Sharp Részalap Bef.jegy B sorozat EUR	2,998,589	0.06
D240221	100,000	0.00
EURO	3,953,837	0.08
USA DOLLÁR	726,662	0.01
<b>Követelések összesen</b>	<b>7,779,088</b>	<b>0.16</b>
<b>Egyéb eszközök</b>		
IRS	92,910,820	1.89
IRS Összesen	92,910,820	1.89
CFD	2,710,438	0.06
CFD Összesen	2,710,438	0.06
Opciók	4,108,800	0.08
Opciók összesen	4,108,800	0.08
Határidős	350,349,516	7.14
Határidős összesen	350,349,516	7.14
<b>Egyéb eszközök összesen</b>	<b>450,079,574</b>	<b>9.17</b>
<b>Eszközök összesen</b>	<b>4,900,143,545</b>	<b>101.54</b>
<b>Kötelezettségek</b>		
<i>Díjak</i>		
Alapkezelői díj 'A'	-20,070,413	-0.41
Alapkezelői díj 'B'	-1,748,499	-0.04
Alapkezelői díj 'I'	-190,045	0.00
Elemzési és kutatási díj BCA	-99,934	0.00
Felügyeleti díj	-433,757	-0.01
Könyvelési díj	-189,978	0.00
Könyvvizsgálói díj	-324,337	-0.01
Különadó	-571,116	-0.01
Letétkezelői díj	-204,881	0.00

Sikerdíj 'A'	-50,204,324	-1.02
Sikerdíj 'I'	-1,549,547	-0.03
<i>Díjak összesen</i>	<i>-75,586,831</i>	<i>-1.54</i>
<b>Kötelezettségek összesen</b>	<b>-75,586,831</b>	<b>-1.54</b>
<b>Nettó eszközérték</b>	<b>4,907,922,633</b>	<b>100.00</b>

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

Befektetési jegy					2022.12.31	2023.06.30
Alap	Sorozat	Deviza	ISIN			
Accorde Sharp Származtatott Részalap (db)	A	HUF	HU0000717590	4,467,480,215	3,558,099,507	
Accorde Sharp Származtatott Részalap (db)	B	EUR	HU0000725460	980,513	1,185,158	
Accorde Sharp Származtatott Részalap (db)	I	USD	HU0000725452	89,568,333	89,568,333	

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

Befektetési jegy					2022.12.31	2023.06.30
Alap	Sorozat	Deviza	ISIN			
Accorde Sharp Származtatott Részalap	A	HUF	HU0000717590	1.083302	1.218849	
Accorde Sharp Származtatott Részalap	B	EUR	HU0000725460	0.982362	1.041714	
Accorde Sharp Származtatott Részalap	I	USD	HU0000725452	1.116936	1.260934	

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

Befektetési alap eszközállományának összetétele						
Megnevezés	Nyitó állomány		(%)	Záró állomány		(%)
Tőzsdén hivatalosan jegyzett értékpapírok	524,879,424	9.78	863,448,792	17.59		
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	431,568,429	8.04	397,565,355	8.10		
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	1,273,105,888	25.93	2,339,818,634	47.67		
<b>* A Nettó eszközérték százalékos arányában</b>						

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 (%)
D240221	HU0000524624	2023.04.13	2024.02.15	28,000,000	100.00	0.57
<b>Összesen</b>				<b>28,000,000</b>		<b>0.57</b>

### **Koncentrációra vonatkozó adatok**

- A legnagyobb biztosítékkibocsátók:

Biztosítékkibocsátó neve	Eszköz neve	Darabszám
Accorde Alapkezelő Zrt.	Accorde Prizma Alap Bef.jegy B sorozat EUR	75,000

- A legfontosabb szerződő felek:

Szerződő fél	Kölcsönbe adott értékpapírok	ISIN	Ügylet kezdete	Ügylet vége	Ügylet értéke
1. ügyfél	D240221	HU0000524624	2023.04.13	2024.02.15	28,000,000

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

### **Biztosítékokra vonatkozó adatok**

Biztosíték típusa	Lejárati profil
Biztosíték pénzneme	Nyitott lejáratú
	HUF EUR USD

Kollektív befektetési formák	0	84,040	0
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	0	0	0

### *A kapott biztosítékok letéti őrzése*

Letétkezelő neve	Őrzött biztosítékok összege (HUF)
Concorde Értékpapír Zrt.	31,189,589

### *Értékpapír kölcsönökre vonatkozó adatok*

Kölcsönbe adott értékpapírok	Lejáratil profil 91 – 365 nap (HUF)	Lejáratil profil 90 nap alatt (HUF)
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	28,000,000	0

### *Az értékpapír kölcsönzési ügyletek hozamára és költségeire vonatkozó adatok*

Kölcsönbe adott értékpapírok	ISIN	Ügylet kezdete	Ügylet vége	Ügylet lejáratkorigi teljes díja (HUF)	Eddig felszámolt díj (HUF)	Eddig felszámolt díj (%)
D240221	HU0000524624	2023.04.13	2024.02.15	208,583	52,823	25.32

## VI. Kockázati profi

Az Alap kockázati mutatója: 3.

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 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>Accorde Sharp Származtatott Részalap</i>	2023.01.31	102.00
<i>Accorde Sharp Származtatott Részalap</i>	2023.02.28	117.90
<i>Accorde Sharp Származtatott Részalap</i>	2023.03.31	105.60
<i>Accorde Sharp Származtatott Részalap</i>	2023.04.28	104.40
<i>Accorde Sharp Származtatott Részalap</i>	2023.05.31	109.00
<i>Accorde Sharp Származtatott Részalap</i>	2023.06.30	107.21

A fenti táblázat mutatja az ABA által alkalmazott tőkeáttétel mértékének változását a 2023. 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, 2023. 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.