

az

EQUILOR Dinamikus Portfólió Származtatott Befektetési Alap

2018. első féléves jelentése

Dátum: 2018. augusztus 28

Készítette:
EQUILOR Alapkezelő Zrt.
Székhely: 1037 Budapest
Montevideo u. 2/C.
Cégjegyzékszám: 01-10-047344



A EQUILOR Alapkezelő Zrt. (székhely: 1037 Budapest, Montevideo u. 2/C., Cg. 01-10-047344) a kollektív befektetési formákról és kezelőikről, valamint egyes pénzügyi tárgyú törvények módosításáról szóló 2014. évi XVI. törvény 6. számú melléklete rendelkezéseinek megfelelően az alábbiakban tájékoztatja az EQUILOR Dinamikus Portfólió Származtatott Befektetési Alap (a továbbiakban: Alap) befektetési jegyeinek tulajdonosait a 2018. első félév működési eredményéről.

I. Az EQUILOR Dinamikus Portfólió Származtatott Alap számszaki adatai

1. Vagyonkimutatás

A befektetési alap eszközeinek és forrásainak tételes összetétele, a befektetési politikában meghatározott kategóriák szerint, a tárgyidőszak elején és végén, valamint az adott eszközök összes eszközön belüli aránya.

	2017.12.31		2018.06.29	
	HUF	NEÉ %-ában	HUF	NEÉ %-ában
Banki egyenlegek	283 058 500	86,67%	101 817 931	34,72%
Átruházható értékpapírok	45 174 969	13,83%	197 509 004	67,36%
Egyéb eszközök	-676 146	-0,21%	2 968 744	1,01%
Összes eszköz	327 557 324	100,30%	302 295 679	103,09%
Kötelezettségek	1 039 551	0,32%	898 095	0,31%
Nettó Eszközérték	326 576 781	100,00%	293 229 521	100,00%

2. A forgalomban levő befektetési jegyek száma

Tárgynap (T):	2018.06.29.
Darabszám (db):	355 355 443

3. Az egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

Tárgynap (T):	2018.06.29.
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	0,825172

4. A befektetési alap összetétele, az egyes eszközök összes eszközön belüli aránya

	2017.12.31.		2018.06.29.	
	HUF	%	HUF	%
tőzsdén hivatalosan jegyzett, átruházható értékpapírok	45 174 970	13,83%	168 146 982	57,34%
más szabályzott piacon forgalmazott, átruházható értékpapírok	-	-	-	-
közelmúltban forgalomba hozott, átruházható értékpapírok	-	-	-	-
egyéb átruházható értékpapírok	-	-	-	-

hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	-	-	29 362 022	10,01%
származtatott ügyletek	-676 174	-0,21%	-	-
egyéb eszközök, kötelezettségek, passzív időbeli elhatárolások	281 401 811	86,22%	95 720 517	32,64%
Nettó Eszközérték	326 576 781	100,00%	293 229 521	100,00%

Az Alap befektetési politikája 2018. I. félévében nem módosult. A tárgyidőszakban az egyes eszközök részaránya az Alap kezelési szabályzatában rögzített limitrendszeren belül változott.

II. Egyéb információk

1. Az Alap 2018. évi első félévi költségeinek tételes kimutatását az alábbi táblázat tartalmazza:

	2018.06.29.
	eFt-ban
Alapkezelői díj	2 996
Letétkezelői díj	90
Megbízási díj	1 703
Felügyeleti díj	37
Könyvvizsgálói díj	127
Bankköltség	23
Egyéb költség	449
Könyvelési díj	372
Működési költség összesen	5 797

2. Tőkeáttételre vonatkozó információk:

A tárgyidőszakban az Alap által alkalmazható tőkeáttétel mértékében változás nem következett be. Az Alap által alkalmazott tőkeáttétel teljes összege a tárgyidőszak végén: 461 666 964 Ft.

Az Alap a tárgyidőszakban értékpapír-finanszírozási ügyletet és teljeshozam-csereügyletet nem kötött.

3. Az Alap nem likvid eszközeire vonatkozó információk, likviditáskezeléssel kapcsolatos új megállapodás, az Alap aktuális kockázati profilja és az Alapkezelő által e kockázatok kezelése érdekében alkalmazott kockázatkezelési rendszerek

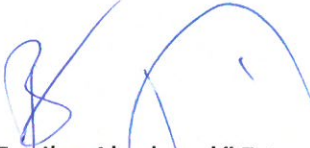
Az Alap portfóliójában 2018 első félévében nem volt olyan eszköz, amelyre illikvid jellegénél fogva különleges szabályok vonatkoztak volna.

A tárgyidőszakban az Alap tekintetében a visszaváltást korlátozó rendelkezések bevezetésére nem került sor, a likviditással kapcsolatos rendelkezésekben változás nem következett be.

Az Alap kockázat-nyereség mutatója: 4 (az 1 – 7 közötti skálán)

A kockázat/nyereség mutató az Alap eszközallokációjának elmúlt 5 éves szimulált hozamadatain alapszik. A kockázat/nyereség profil a múltira vonatkozik és nem tekinthető a jövőbeni kockázat/nyereség profil megbízható mutatójának. Az 1. kategóriába történő besorolás nem jelenti azt, hogy kockázatmentes befektetésről van szó. A kockázati besorolás idővel módosulhat. A 4-es kockázati besorolás az elmúlt 5 év piaci viszonyait tükröző árfolyam-ingadozások eredménye, és annak köszönhető, hogy az Alap eszközeit változó mértékben részvényekbe, kötvényekbe vagy származtatott eszközökbe fektetheti, amiket számottevő árfolyam-ingadozás is jellemezhet. Az abszolút hozamú alapok azonban időnként részvény alapokhoz hasonló kockázati profillal is rendelkezhetnek, így akár 7-es kategóriába is kerülhetnek egy adott időszak során.

Az Alap kockázati profiljának bemutatását az Alap Tájékoztatója tartalmazza. Az Alapkezelő biztosítja, hogy befektetési alap kockázati profilja megfeleljen a befektetési alap méretének, portfólió szerkezetének, befektetési stratégiáinak és célkitűzéseinek, a befektetési alap kezelési szabályzatában, tájékoztatójában és az ajánlattételi dokumentumokban foglaltak szerint. Az Alapkezelő az Alap releváns kockázatokra való érzékenységének mérése érdekében a jogszabályi előírások és belső szabályzatai alapján forgatókönyv-elemzést és stressz tesztet hajt végre.



Equilor Alapkezelő Zrt.

Equilor Alapkezelő Zrt.
H-1037 Budapest
Montevideo utca 2/c
Asz.: 23838442-2-41
3.