

az

## **EQUILOR Fregatt 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 Fregatt Befektetési Alap (a továbbiakban: Alap) befektetési jegyeinek tulajdonosait a 2018. év első félévének működési eredményéről.

## Az EQUILOR Fregatt Befektetési 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	115 554 772	75,53%	42 617 793	59,47%
Átruházható értékpapírok	38 043 728	24,87%	33 660 138	46,97%
Egyéb eszközök	-	-	-	-
Összes eszköz	153 598 500	100,40%	76 277 931	106,44%
Kötelezettségek	639 763	0,42%	4 612 456	6,44%
Nettó Eszközérték	152 982 046	100,00%	71 665 479	100,00%

### 2. A forgalomban levő befektetési jegyek száma

Tárgynap (T):	2018.06.29.
Darabszám (db):	60 576 630

### 3. Az egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

Tárgynap (T):	2018.06.29.
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,183055

### 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	15 737 291	10,29%	13 112 126	18,30%
más szabályzott piacon forgalmazott, átruházható értékpapírok	-	-	-	-
közelmúltban forgalomba hozott,	-	-	-	-

átruházható értékpapírok				
egyéb átruházható értékpapírok	-	-	-	-
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	22 306 436	14,58%	20 548 012	28,67%
származtatott ügyletek	-	-	-	-
egyéb eszközök, kötelezettségek, passzív időbeli elhatárolások	114 938 319	75,13%	38 005 341	53,03%
<b>Nettó Eszközérték</b>	<b>152 982 046</b>	<b>100,00%</b>	<b>71 665 479</b>	<b>100,00%</b>

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

### Egyéb információk

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

	<b>2018.06.29.</b>
	eFt-ban
Alapkezelői díj	299
Sikerdíj	357
Letétkezelői díj	21
Megbízási díj	32
Felügyeleti díj	11
Könyvvizsgálói díj	96
Bankköltség	11
Egyéb költség	40
Könyvelési díj	330
<b>Működési költség összesen</b>	<b>1 196</b>

### 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: 71 665 474 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: 3 (az 1 – 7 közötti skálán)

A kockázat/nyereség mutató az elmúlt 5 év heti hozam adatait veszi alapul az Alap indulásától az Alap hozama, azt megelőzően a referenciaérték alapján. A kockázat/nyereség profil a múltra 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 feltüntetett kockázati besorolás nem marad garantáltan változatlan, és az Alap kategorizálása idővel módosulhat. Az alacsony kockázati besorolás annak köszönhető, hogy az Alap eszközeit elsősorban a Magyar Állam által garantált értékpapírok jelentik.

A befektetési jegy valamely kockázati osztályba sorolásánál előfordulhat, hogy a számítási modell nem vesz figyelembe minden kockázatot.

Az Alap kockázati profiljának bemutatását az Alap Tájékoztatója tartalmazza. Az Alapkezelő biztosítja, hogy befektetési alap kockázati profilja megfeleljen a befektetési alap méretének, portfóliószerkezetének, 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.