

az

EQUILOR Hydra 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 Hydra Származtatott Befektetési Alap (a továbbiakban: Alap) befektetési jegyeinek tulajdonosait a 2018. év első félévének működési eredményéről.

I. Az EQUILOR Hydra Származtatott 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	371 484 768	93,76%	372 735 510	64,54%
Átruházható értékpapírok	-	-	200 356 232	34,69%
Egyéb eszközök	25 284 998	6,38%	7 019 086	1,22%
Összes eszköz	396 769 766	100,14%	580 110 828	100,44%
Kötelezettségek	753 107	0,19%	2 563 113	0,44%
Nettó Eszközérték	396 229 038	100,00%	577 547 713	100,00%

2. A forgalomban levő befektetési jegyek száma

Tárgynap (T):	2018.06.29.
Darabszám (db):	575 791 524

3. Az egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

Tárgynap (T):	2018.06.29.
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,00305

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	-	-	194 094 500	33,61%
más szabályzott piacon forgalmazott, átruházható értékpapírok	-	-	-	-
közelmúltban forgalomba hozott, átruházható értékpapírok	-	-	-	-

egyéb átruházható értékpapírok	-	-	-	-
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	-	-	6 261 732	1,08%
fix, változó kamatozású bankbetétek	371 484 768	93,76%	-	-
származtatott ügyletek	-	-	-	-
egyéb eszközök, kötelezettségek, passzív időbeli elhatárolások	24 744 270	6,24%	377 191 481	65,31%
Nettó Eszközérték	396 229 038	100,00%	577 547 713	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	4 872
Sikerdíj	624
Letétkezelői díj	146
Megbízási díj	721
Felügyeleti díj	62
Könyvvizsgálói díj	63
Bankköltség	34
Egyéb költség	276
Könyvelési díj	376
Működési költség összesen	7 174

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: 655 865 746 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 a tárgyidőszakban értékpapír-finanszírozási ügyletet és teljeshozam-csereügyletet nem kötött.

Az Alap kockázat-nyereség mutatója: 3 (az 1 – 7 közötti skálán)

A kockázat/nyereség mutató a tervezett eszközallokáció elmúlt 5 éves szimulált heti hozamadatain alapszik. A kockázat/nyereség profil a múltira vonatkozik, és szimulált adatokra épül, ezért nem tekinthető feltétlenül a jövőbeni kockázat/nyereség profil megbízható mutatójának. Az 1. kategóriába történő besorolás nem jelent kockázatmentes befektetést. A feltüntetett kockázati besorolás nem marad garantáltan változatlan, és az Alap kategorizálása idővel módosulhat. A 3-as kockázati kategóriába történő kockázati besorolást az indokolja, hogy bár az Alap saját tőkéjét hazai és külföldi részvényekbe, kötvényekbe, illetve határidős ügyletekbe fektetheti, nagyrészt rövid lejáratú állampapírokat is tervez tartani. A befektetési jegy valamely kockázati osztályba sorolásánál előfordulhat, hogy a számítási modell nem vesz figyelembe minden kockázatot.

Az Alap származtatott alap, így a derivatív eszközök kezelése és jelenléte kiemelt fontossággal bír. A származtatott ügyletek jellegüknél fogva sokkal magasabb kockázatot hordoznak magukban, mint a tőkeáttétellel nem rendelkező befektetési formák. Ezen kockázatok ugyan befektetési technikákkal csökkenthetők, azonban teljesen meg nem szüntethetők.

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.