

az

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

I. Az EQUILOR Magnus 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	18 984 937	13,04%	113 666 026	102,64%
Átruházható értékpapírok	124 781 373	85,68%		0,00%
Egyéb eszközök	2 538 505	1,74%	28 917	0,03%
Összes eszköz	146 304 815	100,46%	113 694 943	102,67%
Kötelezettségek	690 074	0,47%	2 954 114	2,67%
Nettó Eszközérték	145 635 855	100,00%	110 740 829	100,00%

*Az Alap devizaneme EUR, amit MNB középárfolyamon váltottunk át forintra (2017.12.31. EUR/HUF: 310,14
2018.06.29. EUR/HUF: 328,60)

2. A forgalomban levő befektetési jegyek száma

Tárgynap (T):	2018.06.29.
Darabszám (db):	37 483 389

3. Az egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

Tárgynap (T):	2018.06.29.
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	0,008991

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	66 607 614	45,74%	-	-
más szabályzott piacon forgalmazott, átruházható értékpapírok	-	-	-	-

közelmúltban forgalomba hozott, átruházható értékpapírok	-	-	-	-
egyéb átruházható értékpapírok	-	-	-	-
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	58 098 957	39,89%	-	-
származtatott ügyletek	2 538 505	1,74%	-	-
egyéb eszközök, kötelezettségek, passzív időbeli elhatárolások	18 998 554	12,63%	110 740 829	100%
Nettó Eszközérték	145 635 855	100,00%	110 740 829	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	1 243
Letétkezelői díj	31
Megbízási díj	177
Felügyeleti díj	16
Könyvvizsgálói díj	127
Bankköltség	60
Egyéb költség	1
Könyvelési díj	371
Működési költség összesen	2 026

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: 110.740.829 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 feltüntetett kockázati besorolás nem marad garantáltan változatlan, és az Alap kategorizálása idővel módosulhat. A 4-es kockázati besorolás az elmúlt 5 év piaci viszonyait tükröző árfolyam-ingadozások eredménye, és annak köszönhető, hogy bár az Alap eszközeit változó mértékben részvényekbe, kötvényekbe vagy származtatott eszközökbe fektetheti, amiket számottevő árfolyam-ingadozás is jellemezhet, egyúttal a piaci kockázatok egy részét fedezéssel csökkenti. Az elmúlt időszakban az alap több opciós ügyletet is létesített, mely hozzájárult az alap volatilitásának növekedéséhez.

Az abszolút hozamú alapok időnként részvény alapokhoz hasonló kockázati profillal is rendelkezhetnek, így akár 7-es kategóriába is kerülhetnek egy adott időszak során. 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.