

az

**EQUILOR Private Wealth Management  
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 Private Wealth Management Származtatott Befektetési Alap (a továbbiakban: Alap) befektetési jegyeinek tulajdonosait a 2018. év első félévének működési eredményéről.

### Az EQUILOR PWM 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	219 189 991	96,14%	184 608 511	62,52%
Átruházható értékpapírok	9 118 814	4,00%	111 470 054	37,75%
Egyéb eszközök	-	-	-	-
Összes eszköz	228 308 805	100,14%	296 078 565	100,27%
Kötelezettségek	357 741	0,16%	783 948	0,27%
Nettó Eszközérték	227 982 221	100,00%	295 294 617	100,00%

#### 2. A forgalomban levő befektetési jegyek száma

Tárgynap (T):	2018.06.29.
Darabszám (db):	286 434 400

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

Tárgynap (T):	2018.06.29.
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,030933

#### 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	-	-	19 901 000	6,74%
más szabályzott piacon forgalmazott, átruházható értékpapírok	-	-	-	-
közelmúltban forgalomba hozott,	-	-	-	-

átruházható értékpapírok				
egyéb átruházható értékpapírok	-	-	44 408 869	15,04%
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	9 118 814	4,00%	47 160 185	15,97%
származtatott ügyletek	-	-	-	-
egyéb eszközök, kötelezettségek, passzív időbeli elhatárolások	218 863 407	96,00%	183 824 563	62,25%
<b>Nettó Eszközérték</b>	<b>227 982 221</b>	<b>100,00%</b>	<b>295 294 617</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.

## I. Egyéb információk

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

	2018.06.29.
	eFt-ban
Alapkezelői díj	3 126
Letétkezelői díj	63
Megbízási díj	94
Felügyeleti díj	39
Könyvvizsgálói díj	96
Bankköltség	16
Egyéb költség	17
Könyvelési díj	330
<b>Működési költség összesen</b>	<b>3 781</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: 295 294 616 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: 5 (az 1 – 7 közötti skálán)

A kockázat/nyereség mutató egy 100%-ban részvényekből álló, kockázatosnak tekinthető portfólió elmúlt 5 éves szimulált heti hozamadatain alapszik. A kockázat/nyereség profil a múltra 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 5-ös kockázati kategóriába történő kockázati besorolást az indokolja, hogy az Alap saját tőkéjét teljes egészében kockázatos eszközökbe, többek között hazai és külföldi részvényekbe, kötvényekbe, illetve határidős ügyletekbe fektetheti. 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.