

az

# **EQUILOR Hydra Származtatott Befektetési Alap** 2021. első féléves jelentése

Dátum: 2021. augusztus 27.

**Készítette:**

**EQUILOR Alapkezelő Zrt.**

**Székhely: 1026 Budapest**

**Pasaréti út 122-124.**

**Cégjegyzékszám: 01-10-047344**



A EQUILOR Alapkezelő Zrt. (székhely: 1026 Budapest, Pasaréti út 122-124., 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 2021. 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.

	2020.12.31		2021.06.30	
	HUF	NEÉ %-ában	HUF	NEÉ %-ában
Banki egyenlegek	20 127 767	8,13%	99 440 429	35,25%
Átruházható értékpapírok	238 972 852	96,50%	186 719 611	66,18%
Származékos ügyletek	699 309	0,28%		0,00%
Egyéb eszközök	3 440 008	1,39%	217 312	0,08%
Összes eszköz	263 239 936	106,30%	286 377 352	101,51%
Kötelezettségek	-15 610 637	-6,30%	-4 246 331	-1,51%
<b>Nettó Eszközérték</b>	<b>247 629 299</b>	<b>100,00%</b>	<b>282 131 021</b>	<b>100,00%</b>

A táblázat az időszak utolsó forgalmazási napjára érvényes nettó eszközérték alapján készült.

### 2. A forgalomban levő befektetési jegyek száma

Tárgynap (T):	2021.06.30.
Darabszám (db):	277 136 331

A táblázat az időszak utolsó forgalmazási napjára érvényes nettó eszközérték alapján készült.

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

Tárgynap (T):	2021.06.30.
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,018023

A táblázat az időszak utolsó forgalmazási napjára érvényes nettó eszközérték alapján készült.

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

	2020.12.31		2021.06.30	
	HUF	A nettó eszközérték %-ában	HUF	A nettó eszközérték %-ában
tőzsdén hivatalosan jegyzett, átruházható értékpapírok	212 932 165	85,99%	173 838 820	61,62%
más szabályzott piacon forgalmazott, átruházható értékpapírok				
közelmúltban forgalomba hozott, átruházható értékpapírok				
egyéb átruházható értékpapírok				
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	26 040 687	10,52%	12 880 791	4,57%

A táblázat az időszak utolsó forgalmazási napjára érvényes nettó eszközérték alapján készült.

Az alap a befektetési politikájának megfelelően több eszközosztályban is felvett pozíciókat a félév folyamán. Elsősorban a hazai és az amerikai piacon fektetett be részvényekbe, főként rövidtávú mozgásokat kihasználva. Ezen felül főbb amerikai index határidők csökkenésére spekulált. A tőzsdén hivatalosan jegyzett, átruházható értékpapírok esetében jelentős csökkenés következett be, melynek során 86% körüli szintről 60% körülre csökkentek ezen eszközök teljes portfólióhoz viszonyított részaránya.

**II. Egyéb információk****1. Az Alap 2021. évi első félévi költségeinek tételes kimutatását az alábbi táblázat tartalmazza:**

	<b>2021.06.30</b>
	eFt-ban
Alapkezelői díj	2 574
Teljesítmény díj	2 722
Letétkezelői díj	77
Megbízási díj	1 477
Felügyeleti díj	45
Könyvvizsgálói díj	127
Bankköltség	25
Forgalmazási díj	75
Egyéb költség	0
Könyvelési díj	445
<b>Működési költség összesen</b>	<b>7 567</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: 94 097 052 Ft (A tőkeáttétellel növelt nettó eszközérték csökkentve a befektetési alap tényleges nettó eszközértékével az időszak végén).

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 2021 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 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 5-ös kockázati kategóriába történő kockázati besorolást az indokolja, hogy az Alap saját tőkéjét hazai és külföldi részvényekbe, kötvényekbe, rövid lejáratú állampapírokba, illetve határidős ügyletekbe fekteti. 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 szüntethetőek.

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.