

az

# **EQUILOR Magnus EUR 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 Magnus Befektetési Alap (a továbbiakban: Alap) befektetési jegyeinek tulajdonosait a 2021. 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.

	2020.12.31		2021.06.30	
	HUF	NEÉ %-ában	HUF	NEÉ %-ában
<b>Banki egyenlegek</b>	10 959 012	20,22%	90 734 600	58,50%
<b>Átruházható értékpapírok</b>	45 218 429	83,44%	65 842 953	42,45%
<b>Származékos ügyletek</b>	240 986	0,44%	0	0,00%
<b>Egyéb eszközök</b>	9 859	0,02%	214 659	0,14%
<b>Összes eszköz</b>	56 428 286	104,12%	156 792 212	101,08%
<b>Kötelezettségek</b>	-2 233 135	-4,12%	-1 682 082	-1,08%
<b>Nettó Eszközérték</b>	54 195 151	100,00%	155 110 130	100,00%

Az euróban nyilvántartott összegek az időszak utolsó banki munkanapján érvényes MNB árfolyamon forintra átszámolva lettek meghatározva. (351,9 EURHUF)

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):	46 913 003

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:	0,009396

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	31 299 746	59,93%	51 839 093	33,42%
más szabályzott piacon forgalmazott, átruházható értékpapírok				
közelmúltban forgalomba hozott, átruházható értékpapírok				
egyéb átruházható értékpapírok				
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	12 280 606	23,51%	14 003 861	9,03%

A táblázat az időszak utolsó forgalmazási napjára érvényes nettó eszközérték alapján készült. Az euróban nyilvántartott összegek az időszak utolsó banki munkanapján érvényes MNB árfolyamon forintra átszámolva lettek meghatározva. (351,9 EURHUF)

2021 első félévében csökkentette a tőzsdén hivatalosan jegyzett, átruházható valamint a hitelviszonyt megtestesítő értékpapírokban lévő kitétséget az alap. A relatív csökkenés oka a félév folyamán beáramló tőke és ezzel szemben alacsonyabb kockázati kitétség vállalása volt.

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

	2021.06.30
	eFt-ban
Alapkezelői díj	960
Teljesítmény díj	829
Letétkezelői díj	35
Megbízási díj	252
Felügyeleti díj	26
Könyvvizsgálói díj	127
Bankköltség	41
Forgalmazási díj	150
Egyéb költség	45
Könyvelési díj	400
<b>Működési költség összesen</b>	<b>2 865</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: 158 625 EUR. (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: 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 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.