

EQUILOR Magnus EUR Származtatott Befektetési Alap

2023. féléves jelentés

Dátum: 2023. augusztus 14.

Készítette:

EQUILOR Alapkezelő Zrt.

Székhely: 1026 Budapest

Pasaréti út 122-124.

Cégjegyzékszám: 01-10-047344



Az 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 140. § rendelkezéseinek megfelelően az alábbiakban tájékoztatja az EQUILOR Magnus EUR Származtatott Befektetési Alap (a továbbiakban: Alap) befektetési jegyeinek tulajdonosait a 2023. első félév működési eredményéről.

I. Az EQUILOR Magnus EUR Származtatott Befektetési Alap számszaki adatai

1. Vagyongkimutatás

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.

| Megnevezés | 2022.12.31 | | 2023.06.30 | |
|--------------------------|----------------------|------------------------|----------------------|------------------------|
| | Összeg / Érték (HUF) | A NEÉ százalékában (%) | Összeg / Érték (HUF) | A NEÉ százalékában (%) |
| Banki egyenlegek | 87 048 170 | 60,41 | 53 273 485 | 33,03 |
| Átruházható értékpapírok | 57 464 656 | 39,88 | 131 752 263 | 81,68 |
| Egyéb eszközök | 538 | 0,06 | 13 516 | 3,39 |
| Összes eszköz | 144 712 494 | 100,43 | 190 501 029 | 118,09 |
| Kötelezettségek | -613 107 | -0,43 | -28 729 544 | -17,81 |
| Nettó eszközérték | 144 099 387 | 100,00 | 161 312 397 | 100,00 |

A euróban nyilvántartott összegek az időszak utolsó banki munkanapján érvényes MNB árfolyamon forintra átszámolva lettek meghatározva. (371,13 EURHUF)

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

2. A forgalomban levő befektetési jegyek száma

| | |
|-----------------|-------------|
| Tárgynap (T): | 2023.06.30. |
| Darabszám (db): | 49 805 362 |

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

3. Az egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

| | |
|------------------------------------|-------------|
| Tárgynap (T): | 2023.06.30. |
| Egy jegyre jutó nettó eszközérték: | 0,008727 |

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

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

| | 2022.12.31 | | 2023.06.30 | |
|---|------------|-------|-------------|-------|
| | Ft | % | Ft | % |
| A tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok | 46 753 102 | 32,45 | 122 689 640 | 76,06 |
| Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok | | | | |
| A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok | | | | |
| Egyéb átruházható értékpapírok | | | | |
| Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok | 10 711 554 | 7,43 | 9 062 623 | 5,62 |

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

A euróban nyilvántartott összegek az időszak utolsó banki munkanapján érvényes MNB árfolyamon forintra átszámolva lettek meghatározva. (371,13 EURHUF)

2023 első félévében növelte a tőzsdén hivatalosan jegyzett, átruházható valamint a hitelviszonyt megtestesítő értékpapírokban lévő kitétségét az alap. Az előbbi 32,45%-ról 76,6%-ra emelkedett, míg az utóbbi több, mint 2 százalékkal csökkent a félév során.

II. Egyéb információk

1. Az Alap 2023. évi első félévi költségeinek tételes kimutatását az alábbi táblázat tartalmazza:

| | 2023.06.30. |
|----------------------------------|--------------|
| | eFt-ban |
| Alapkezelői díj | 1 472 |
| Teljesítménydíj | 0 |
| Letétkezelői díj | 37 |
| Megbízási díj | 1 404 |
| Felügyeleti díj | 26 |
| Könyvvizsgálói díj | 127 |
| Bankköltség | 60 |
| Forgalmazási díj | 150 |
| Egyéb költség | 0 |
| Könyvelési díj | 433 |
| Működési költség összesen | 3 709 |

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: 24 604 291 Ft.

Az euróban nyilvántartott összegek az időszak utolsó banki munkanapján érvényes MNB árfolyamon forintra átszámolva lettek meghatározva. (371,13 EURHUF)

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 2023 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 összesített kockázati mutatója: 4 (az 1 – 7 közötti skálán)

Az összesített kockázati mutató megmutatja az Alap kockázati profilját az Alap piaci kockázati mértéke és a hitelkockázati mértéke alapján. Az összesített kockázati mutató a múltira vonatkozik és nem tekinthető a jövőbeni kockázati 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 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, portfólió szerkezetének, 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.