

# MFC Equity Mercury 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 MFC Equity Mercury Befektetési Alap (a továbbiakban: Alap) befektetési jegyeinek tulajdonosait a 2023. első félév működési eredményéről.

## I. Az MFC Equity Mercury 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.

| Megnevezés               | 2022.12.31           |                        | 2023.06.30           |                        |
|--------------------------|----------------------|------------------------|----------------------|------------------------|
|                          | Összeg / Érték (HUF) | A NEÉ százalékában (%) | Összeg / Érték (HUF) | A NEÉ százalékában (%) |
| Banki egyenlegek         | 7 972 784            | 0,81                   | 112 733 830          | 10,49                  |
| Átruházható értékpapírok | 979 346 861          | 99,69                  | 961 443 450          | 89,5                   |
| Egyéb eszközök           | 1 614 758            | 0,16                   | 2 456 035            | 0,23                   |
| Összes eszköz            | 988 934 403          | 100,66                 | 1 076 633 658        | 100,23                 |
| Kötelezettségek          | -6 509 366           | -0,66                  | -2 439 600           | -0,23                  |
| Nettó eszközérték        | 982 425 037          | 100                    | 1 074 194 058        | 100                    |

A dollárban nyilvántartott összegek az időszak utolsó banki munkanapján érvényes MNB árfolyamon forintra átszámolva lettek meghatározva. (342,4 USDHUF)

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

### 2. A forgalomban levő befektetési jegyek száma

|                      |                    |
|----------------------|--------------------|
| <b>Tárgynap (T):</b> | <b>2023.06.30.</b> |
| Darabszám (db):      | 26 641             |

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

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

|                                    |                    |
|------------------------------------|--------------------|
| <b>Tárgynap (T):</b>               | <b>2023.06.30.</b> |
| Egy jegyre jutó nettó eszközérték: | 117,760174         |

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       | 979 346 861 | 99,69 | 961 443 450 | 89,5 |
| Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok |             |       |             |      |
| A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok     |             |       |             |      |
| Egyéb átruházható értékpapírok                                |             |       |             |      |
| Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok                       |             |       |             |      |

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

A dollárban nyilvántartott összegek az időszak utolsó banki munkanapján érvényes MNB árfolyamon forintra átszámolva lettek meghatározva. (342,4 USDHUF)

Az alap eszközeit 2023 első félévében jellemzően amerikai részvényekben, illetve a likviditás biztosításának érdekében amerikai dollárban tartotta.

A vizsgált időszak során jellemzően az eszközök 90-100%-a befektetési politikának megfelelő részvényekbe volt befektetve. Azon időszakok során, amikor a piaci volatilitás megnőtt és/vagy a részvény piac értékeltsége túlrazottnak tűnt, az Alapkezelő jellemzően inkább csak 90%-osan fektetett be, míg ellenkező esetben törekedett a 100%-os befektetettségre. Tekintve, hogy a 2022-es év végén a részvények nyomottabb szinteken tartózkodtak, azonban a piaci hangulat javult a kínai újraindítás és a Fed lassításának reményében, az eszközök közel 100%-osan részvényekbe voltak befektetve. Ezzel szemben a 2023-as fél év végére a részvények elérték éves csúcspontjukat, így a részvények súlyából ideiglenes visszábbvett az Alapkezelő.

## II. Egyéb információk

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

|                                  | 2023.06.30.  |
|----------------------------------|--------------|
|                                  | eFt-ban      |
| Alapkezelői díj                  | 7 764        |
| Teljesítménydíj                  | 0            |
| Letétkezelői díj                 | 261          |
| Megbízási díj                    | 743          |
| Felügyeleti díj                  | 183          |
| Könyvvizsgálói díj               | 191          |
| Bankköltség                      | 9            |
| Forgalmazási díj                 | 150          |
| Egyéb költség                    | 50           |
| Könyvelési díj                   | 606          |
| <b>Működési költség összesen</b> | <b>9 957</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: 0 Ft.

A dollárban nyilvántartott összegek az időszak utolsó banki munkanapján érvényes MNB árfolyamon forintra átszámolva lettek meghatározva. (342,40 USDHUF)

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, 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.