

az

EQUILOR Optimus Befektetési Alapba Fektető Alap

2016. első féléves jelentése

Dátum: 2016. augusztus 30.

**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 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 Optimus Befektetési Alapba Fektető Alap (a továbbiakban: Alap) befektetési jegyeinek tulajdonosait a 2016. első félév működési eredményéről.

I. Az EQUILOR Optimus Alapok Alapja 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.

| | 2015.12.31 | | 2016.06.30 | |
|--|--------------------|-------------|--------------------|-------------|
| | Ft | % | Ft | % |
| átruházható értékpapírok | 150 440 024 | 81,07% | 230 893 558 | 96,24% |
| fix,változó kamatozású,vagy zéró kupon bankbetét(ek) | 35 400 000 | 19,08% | | 0,00% |
| az alap saját devizanemében | 35 400 000 | 19,08% | | 0,00% |
| származtatott ügylet(ek) | | 0,00% | | 0,00% |
| egyéb eszközök | 177 194 | 0,10% | 9 332 000 | 3,89% |
| összes eszköz | 186 017 218 | 100,24% | 240 225 558 | 100,13% |
| kötelezettségek | -446 844 | -0,24% | -323 267 | -0,13% |
| Nettó eszközérték | 185 570 374 | 100% | 239 902 291 | 100% |

2. A forgalomban levő befektetési jegyek száma a tárgyidőszak elején és végén

| 2015.12.31 | 2016.06.30 |
|----------------|----------------|
| 185 834 109 db | 240 855 196 db |

3. Az egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték a tárgyidőszak elején és végén

| 2015.12.31 | | 2016.06.30 | |
|-------------------|----------------------------------|-------------------|----------------------------------|
| Nettó eszközérték | Egy jegyre eső nettó eszközérték | Nettó eszközérték | Egy jegyre eső nettó eszközérték |
| 185 570 374 | 0,998581 | 239 902 291 | 0,996044 |

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

| | 2015.12.31 | | 2016.06.30 | |
|---|--------------------|----------------|--------------------|----------------|
| | Ft | % | Ft | % |
| a tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok | | 0,00% | | 0,00% |
| más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok | | 0,00% | | 0,00% |
| a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok | | 0,00% | | 0,00% |
| egyéb átruházható értékpapírok | 150 440 024 | 81,07% | 230 893 558 | 96,24% |
| hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok | | 0,00% | | 0,00% |
| fix, változó kamatozású, vagy zéró kupon bankbetét(ek) | 35 400 000 | 19,08% | | 0,00% |
| az alap saját devizanemében | 35 400 000 | 19,08% | | 0,00% |
| származtatott ügylet(ek) | | 0,00% | | 0,00% |
| egyéb eszközök-kötelezettségek, passzív időbeli elhatárolások | -269 650 | -0,15% | 9 008 733 | 3,76% |
| nettó eszközérték | 185 570 374 | 100,00% | 239 902 291 | 100,00% |

Az Equilor Optimus Alapok Alapja 2016 elején eszközeinek 81%-át tartotta négy befektetési alap befektetési jegyeiben. Ezek az Equilor Fregatt Prémium Kötvény Befektetési Alap, az EQUILOR Közép-európai Részvény Befektetési Alap, az EQUILOR Noé Nemzetközi Részvény Befektetési Alap és az Equilor Pillars Származtatott Befektetési Alap befektetési jegyei voltak. A félév során az alapok listája nem változott, csupán az arányokat változtattuk és az időszak végére a befektetési jegyek az alap eszközeinek 96%-át tették ki.

Az Alapkezelő működésében a 2016-os pénzügyi év első félévében nem voltak olyan változások, jelentős üzleti események, amelyek az Alap működését, akár annak befektetési politikájának alakulását jelentősen befolyásolhatták volna.

II. Egyéb információk**1. Az Alap 2016. évi első félévi költségeinek tételes kimutatását az alábbi táblázat tartalmazza:**

| Megnevezés | forint |
|----------------------------------|----------------|
| Letétkezelői díj | 56 333 |
| Felügyeleti díj | 28 000 |
| Könyvvizsgálói díj | 127 000 |
| Bankköltség | 5 714 |
| Egyéb költség | 110 609 |
| Könyvelési díj | 371 400 |
| Működési költség összesen | 699 056 |

2. Tőkeáttételre vonatkozó információk:

A tárgyidőszakban az Alap által alkalmazható tőkeáttétel mértékében változás nem következett be. Az Alap a tárgyidőszakban tőkeáttételt nem alkalmazott, és nem rendelkezett biztosíték vagy tőkeáttételi megállapodással.

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 2016 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 elmúlt 5 évben elért heti referenciahozam adatokat veszi alapul. 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 az alapok - melyekbe az Alap fektet - részvényekbe, kötvényekbe vagy származtatott eszközökbe is fektethetik, amiket számottevő árfolyam-ingadozás is jellemezhet. A mögöttes alapok között részvénytípusú alapok is szerepelhetnek, amelyek 7-es kategóriába is kerülhetnek egy adott időszak során.

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.