

az

# **EQUILOR Private Wealth Management 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 Private Wealth Management Származtatott Befektetési Alap (a továbbiakban: Alap) befektetési jegyeinek tulajdonosait a 2021. év első félévének működési eredményéről.

## Az EQUILOR PWM 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	11 738 046	28,50%	16 612 170	38,81%
Átruházható értékpapírok	30 944 500	75,13%	27 049 781	63,19%
Egyéb eszközök			74 854	0,17%
Összes eszköz	42 682 546	103,63%	43 736 805	102,17%
Kötelezettségek	-1 495 767	-3,63%	-929 516	-2,17%
Nettó Eszközérték	41 186 779	100,00%	42 807 289	100,00%

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):	37 617 238

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:	1,13797

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	10 285 546	24,97%	13 012 693	30,40%
más szabályzott piacon forgalmazott, átruházható értékpapírok				
közelmúltban forgalomba hozott, átruházható értékpapírok				
egyéb átruházható értékpapírok	20 658 954	50,16%	14 037 088	32,79%
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok				

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

A fenti táblázatban feltüntetett befektetési kategóriák a befektetési alap összes eszközeihez viszonyított részarányváltozásáról elmondható, hogy a portfólió összetételében a tárgyidőszakban jelentős változás az egyéb átruházható értékpapírok arányában történt, mely enyhén csökkent.

**I. 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	0
Teljesítménydíj	675
Letétkezelői díj	9
Megbízási díj	52
Felügyeleti díj	8
Könyvvizsgálói díj	95
Bankköltség	17
Forgalmazási díj	150
Egyéb költség	45
Könyvelési díj	356
<b>Működési költség összesen</b>	<b>1 407</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 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 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 4-es kockázati kategóriába történő kockázati besorolást az indokolja, hogy az Alap saját tőkéjét teljes egészében kockázatos eszközökbe, többek között hazai és külföldi részvényekbe, kötvényekbe, illetve határidős ügyletekbe fektetheti. 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.