

# **EQUILOR Private Wealth Management Származtatott Befektetési Alap**

## **2022. féléves jelentés**

Dátum: 2022. augusztus 26.

**Készítette:  
EQUILOR Alapkezelő Zrt.  
Székhely: 1026 Budapest  
Pasaréti út 122-124.  
Céggjegyzékszám: 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 a EQUILOR Private Wealth Management Származtatott Befektetési Alap (a továbbiakban: Alap) befektetési jegyeinek tulajdonosait a 2022. első félév működési eredményéről.

## I. A EQUILOR Private Wealth Management Származtatott 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	2021.12.31		2022.06.30	
	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)
Banki egyenlegek	22 698 996	50,18	4 737 845	90,40
Átruházható értékpapírok	24 531 571	54,23	702412	13,40
Egyéb eszközök	51 299	0,11	392 002 828	19,69
Összes eszköz	47 281 866	104,52	5 440 257	103,80
Kötelezettségek	-2 043 913	-4,52	-199 304	-3,80
Nettó eszközérték	45 237 953	100,00	5 240 953	100,00

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

### 2. A forgalomban levő befektetési jegyek száma

<b>Tárgynap (T):</b>	<b>2022.06.30.</b>
Darabszám (db):	4 466 977

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>2022.06.30.</b>
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1.173266

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

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

	2021.12.31		2022.06.30	
	Ft	%	Ft	%
A tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok	9 474 909	20,94	702 412	13,40
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok				
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok				
Egyéb átruházható értékpapírok	15 056 662	33,28		
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 nullára csökkent. A tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok összetétele is nagyobb változáson ment át, 21%-ról egészen 13,4%-ig csökkenve.

## II. Egyéb információk

### 1. Az Alap 2022. évi első félévi költségeinek tételes kimutatását az alábbi táblázat tartalmazza:

	2022.06.30.
	eFt-ban
Alapkezelői díj	0
Teljesítménydíj	0
Letétkezelői díj	5
Megbízási díj	28
Felügyeleti díj	5
Könyvvizsgálói díj	95
Bankköltség	28
Forgalmazási díj	150
Egyéb költség	0
Könyvelési díj	356
<b>Működési költség összesen</b>	<b>667</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.

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 2022 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 múltra 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 tőkét 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.

Equilor Alapkezelő Zrt.