

EQUILOR Private Wealth Management Származtatott Befektetési Alap

2023. féléves jelentés

Dátum: 2023. augusztus 14.

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 2023. 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	2022.12.31		2023.06.30	
	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)
Banki egyenlegek	131 051 127	26,75	320 028 547	14,40
Átruházható értékpapírok	355 136 431	72,50	1 757 165 761	79,07
Egyéb eszközök	4 204 219	0,86	147 552 602	6,64
Összes eszköz	490 391 777	100,12	2 225 134 304	100,13
Kötelezettségek	-571 921	-0,12	-2 399 249	-0,11
Nettó eszközérték	489 819 856	100,00	2 222 347 660	100,00

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):	1 756 287 215

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:	1,265367

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				
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok				
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok				
Egyéb átruházható értékpapírok				
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	355 136 431	72,50	1 757 165 761	79,07

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 a hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok arányában történt, mely 79,07 százalékra emelkedett az év eleji 72,5 százalékról.

II. Egyéb információk

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

	2023.06.30.
	eFt-ban
Alapkezelői díj	1 367
Teljesítménydíj	0
Letétkezelői díj	205
Megbízási díj	76
Felügyeleti díj	203
Könyvvizsgálói díj	95
Bankköltség	73
Forgalmazási díj	150
Egyéb költség	0
Könyvelési díj	385
Működési költség összesen	2 554

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: 238 738 202 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 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.

Equilor Alapkezelő Zrt.