

az

EQUILOR Progresszív 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



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 6. számú melléklete rendelkezéseinek megfelelően az alábbiakban tájékoztatja az EQUILOR Progresszív Származtatott Befektetési Alap (a továbbiakban: Alap) befektetési jegyeinek tulajdonosait a 2021. első félév működési eredményéről.

I. Az EQUILOR Progresszív 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.

	2020.12.31		2021.06.30	
	HUF	NEÉ %-ában	HUF	NEÉ %-ában
Banki egyenlegek	50 326 729	21,01%	45 739 547	12,37%
Átruházható értékpapírok	201 267 431	84,04%	320 405 225	86,66%
Egyéb eszközök	242 280	0,10%	10 640 441	2,88%
Összes eszköz	251 836 440	105,15%	376 785 213	101,91%
Kötelezettségek	-12 342 934	-5,15%	-7 070 159	-1,91%
Nettó Eszközérték	239 493 506	100,00%	369 715 054	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):	325 387 114

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:	1,136231

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	154 829 297	64,65%	271 383 361	73,40%
más szabályzott piacon forgalmazott, átruházható értékpapírok				
közelmúltban forgalomba hozott, átruházható értékpapírok				
egyéb átruházható értékpapírok				
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	46 438 134	19,39%	49 021 864	13,26%

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

Az alap eszközeit a befektetési politikájának megfelelően több eszközosztályokba fektette. Ilyenek például hazai és külföldi részvényekbe, kötvényekbe állampapírokba, kollektív befektetési értékpapírokba (beleértve az ETF-eket is), illetve a határidős ügyletekbe. Az időszak végén az eszközértékének közel háromnegyed része került tőzsdén jegyzett átruházható értékpapírokba befektetve. A hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok részaránya enyhén csökkent.

II. Egyéb információk**1. Az Alap 2021. évi első félévi költségeinek tételes kimutatását az alábbi táblázat tartalmazza:**

	2021.06.30
	eFt-ban
Alapkezelői díj	3351
Teljesítmény díj	0
Letétkezelői díj	180
Megbízási díj	2251
Felügyeleti díj	59
Könyvvizsgálói díj	191
Bankköltség	26
Forgalmazási díj	150
Egyéb költség	17
Könyvelési díj	371
Működési költség összesen	6 596

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: 237 760 940 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: 5 (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 5-ös kockázati kategóriába történő kockázati besorolást az indokolja, hogy az Alap saját tőkéjét hazai és külföldi részvényekbe, kötvényekbe, illetve határidős ügyletekbe fekteti.

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.