

EQUILOR Progresszív Származtatott Befektetési Alap

2022. féléves jelentés

Dátum: 2022. augusztus 26.

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 140. § rendelkezéseinek megfelelően az alábbiakban tájékoztatja az EQUILOR Progresszív Származtatott Befektetési Alap (a továbbiakban: Alap) befektetési jegyeinek tulajdonosait a 2022. 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.

Megnevezés	2021.12.31		2022.06.30	
	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)
Banki egyenlegek	79 315 813	22,98	152 096 111	40,34
Átruházható értékpapírok	267 953 725	77,64	243 795 738	64,65
Egyéb eszközök	-858 499	-0,24	-15 879 722	-4,21
Összes eszköz	347 563 867	100,70	396 556 206	105,16
Kötelezettségek	-1 265 531	-0,37	-2 930 214	-0,78
Nettó eszközérték	345 145 507	100,00	377 081 909	100,00

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

2. A forgalomban levő befektetési jegyek száma

Tárgynap (T):	2022.06.30.
Darabszám (db):	345 974 027

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

3. Az egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

Tárgynap (T):	2022.06.30.
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1.089914

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	230 432 324	66,76	209 410 595	55,53
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok				
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok				
Egyéb átruházható értékpapírok				
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	37 521 401	10,87	34 385 143	9,12

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 a tőzsdén jegyzett átruházható értékpapírok részaránya lecsökkent 55,53%-ra az év eleji 67% körüli színtről. A hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok részaránya enyhén csökkent, 9,12%-ra.

II. Egyéb információk

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

	2022.06.30.
	eFt-ban
Alapkezelői díj	3 656
Teljesítménydíj	1 847
Letétkezelői díj	180
Megbízási díj	1 355
Felügyeleti díj	64
Könyvvizsgálói díj	191
Bankköltség	11
Forgalmazási díj	150
Egyéb költség	0
Könyvelési díj	373
Működési költség összesen	7 827

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: 316 920 139 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: 5 (az 1 – 7 közötti skálán)

A kockázat/nyereség mutató az elmúlt 5 év heti hozam adatait veszi alapul az Alap indulásától az Alap hozama, azt megelőzően a referenciaérték alapján. 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 jelentős kockázati besorolás annak köszönhető, hogy az Alap saját tőkéjét hazai és külföldi részvényekbe, kötvényekbe, illetve határidős ügyletekbe fekteti.

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.