

# **EQUILOR Progresszív Származtatott Befektetési Alap**

## **2023. féléves jelentés**

Dátum: 2023. augusztus 14.

**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 2023. 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               | 2022.12.31           |                        | 2023.06.30           |                        |
|--------------------------|----------------------|------------------------|----------------------|------------------------|
|                          | Összeg / Érték (HUF) | A NEÉ százalékában (%) | Összeg / Érték (HUF) | A NEÉ százalékában (%) |
| Banki egyenlegek         | 162 659 221          | 36,84                  | 63 176 679           | 14,10                  |
| Átruházható értékpapírok | 283 332 077          | 64,18                  | 434 125 225          | 96,87                  |
| Egyéb eszközök           | 4 058 019            | 0,92                   | 11 976 669           | 2,67                   |
| Összes eszköz            | 450 049 317          | 101,94                 | 512 509 445          | 114,36                 |
| Kötelezettségek          | -8 567 932           | -1,94                  | -61 117 982          | -13,64                 |
| Nettó eszközérték        | 441 481 395          | 100,00                 | 448 160 590          | 100,00                 |

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

### 2. A forgalomban levő befektetési jegyek száma

|                 |                    |
|-----------------|--------------------|
| Tárgynap (T):   | <b>2023.06.30.</b> |
| Darabszám (db): | 379 094 819        |

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

### 3. Az egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

|                                    |                    |
|------------------------------------|--------------------|
| Tárgynap (T):                      | <b>2023.06.30.</b> |
| Egy jegyre jutó nettó eszközérték: | 1,182186           |

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       | 165 446 457 | 37,48 | 269 980 299 | 60, |
| Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok |             |       |             |     |
| A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok     |             |       |             |     |
| Egyéb átruházható értékpapírok                                |             |       |             |     |
| Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok                       | 165 446 457 | 37,48 | 269 980 299 | 60, |

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 60%-ra emelkedett az év eleji 38% körüli szintről. A hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok részaránya 60%-ra emelkedett az év eleji 37,48 százalékos szintről.

## II. Egyéb információk

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

|                                  | 2023.06.30.  |
|----------------------------------|--------------|
|                                  | eFt-ban      |
| Alapkezelői díj                  | 4 385        |
| Teljesítménydíj                  | 0            |
| Letétkezelői díj                 | 180          |
| Megbízási díj                    | 2 530        |
| Felügyeleti díj                  | 77           |
| Könyvvizsgálói díj               | 191          |
| Bankköltség                      | 107          |
| Forgalmazási díj                 | 150          |
| Egyéb költség                    | 28           |
| Könyvelési díj                   | 404          |
| <b>Működési költség összesen</b> | <b>8 052</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: 96 215 809 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.