

az

EQUILOR Közép-Európai Befektetési Alap

2020. első féléves jelentése

Dátum: 2020. augusztus 18.

Készítette:

EQUILOR Alapkezelő Zrt.

Székhely: 1026 Budapest

Pasaréti út 122-124.

Cégjegyzékszám: 01-10-047344



A 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 Közép-Európai Befektetési Alap (a továbbiakban: Alap) befektetési jegyeinek tulajdonosait a 2020. év első félévének működési eredményéről.

I. Az EQUILOR Közép-Európai 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.

	2019.12.31		2020.06.30	
	HUF	NEÉ %-ában	HUF	NEÉ %-ában
Banki egyenlegek	33 948 191	1,76%	44 487 062	2,30%
Átruházható értékpapírok	2 144 850 243	111,05%	1 886 050 726	97,65%
Egyéb eszközök	-	-	3 635 553	-
Összes eszköz	2 178 798 434	112,81%	1 934 173 341	100,14%
Kötelezettségek	13 795 516	0,71%	2 726 050	0,14%
Nettó Eszközérték	2 165 002 918	100,00%	1 931 447 291	100,00%

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

2. A forgalomban levő befektetési jegyek száma

Tárgynap (T):	2020.06.30.
Darabszám (db):	1 815 552 962

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

3. Az egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

Tárgynap (T):	2020.06.30.
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,063834

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

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

Megnevezés	2019.12.31		2020.06.30	
	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)	Összeg / Érték (HUF)	Százalékban (%)
Tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok összesen	2 144 850 243	99,07	1 875 502 613	97,10
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok összesen				
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok összesen				
Egyéb átruházható értékpapírok				
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok összesen			10 548 113	0,55

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

2020 első félévében az alap a befektetési politikájának megfelelően túlnyomó részben részvényeket tartott, azonban azok mértéke időről időre változott. Összességében elmondható, hogy 2020.04.01-ig a részvények a benchmarkban szereplő 100% közelében, áprilistól kezdve pedig az új 97%-os benchmark szint fölött voltak.

II. Egyéb információk**1. Az Alap 2020. évi első félévi költségeinek tételes kimutatását az alábbi táblázat tartalmazza:**

	2020.06.30.
	eFt-ban
Alapkezelői díj	7 448
Letétkezelői díj	466
Megbízási díj	615
Felügyeleti díj	319
Könyvvizsgálói díj	127
Bankköltség	9
Egyéb költség	432
Könyvelési díj	400
Működési költség összesen	9 815

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: 58 139 858 Ft. (A tőkeáttétellel növelt nettó eszközérték csökkentve a befektetési alap tényleges nettó eszközértékével az időszak végén)

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 2020 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 a tárgyidőszakban értékpapír-finanszírozási ügyletet és teljeshozam-csereügyletet nem kötött.

Az Alap kockázat-nyereség mutatója: 6 (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 kockázati besorolás idővel módosulhat. A magas kockázati besorolást az indokolja, 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.