

az

**EQUILOR Private Wealth Management  
Származtatott Befektetési Alap**

2019. első féléves jelentése

Dátum: 2019. augusztus 28.

**Készítette:**

**EQUILOR Alapkezelő Zrt.**

**Székhely: 1037 Budapest**

**Montevideo u. 2/C.**

**Cégjegyzékszám: 01-10-047344**



A EQUILOR Alapkezelő Zrt. (székhely: 1037 Budapest, Montevideo u. 2/C., 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 Private Wealth Management Származtatott Befektetési Alap (a továbbiakban: Alap) befektetési jegyeinek tulajdonosait a 2019. év első félévének működési eredményéről.

## Az EQUILOR PWM 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	2018.12.28		2019.06.28	
	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)	Összeg / Érték (HUF)	A NEÉ százalékában (%)
Banki egyenlegek	56 417 264	31,98	33 991 454	25,68
Átruházható értékpapírok	120 615 644	68,36	99 657 994	75,28
Egyéb eszközök		0,00		0,00
Összes eszköz	177 032 908	100,34	133 649 448	100,96
Kötelezettségek	-599 421	-0,34	-1 267 818	-0,96
Nettó eszközérték	176 433 487	100,00	132 381 627	100,00

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

### 2. A forgalomban levő befektetési jegyek száma

Tárgynap (T):	2019.06.28.
Darabszám (db):	128 732 212

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

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

Tárgynap (T):	2019.06.28.
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,028349

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

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

	2018.12.28		2019.06.28	
	HUF	%	HUF	%
tőzsdén hivatalosan jegyzett, átruházható értékpapírok	30 644 926	17,37%	19 735 048	14,91%
más szabályzott piacon forgalmazott, átruházható értékpapírok	-	-	-	-
közelmúltban forgalomba hozott, átruházható értékpapírok	-	-	-	-
egyéb átruházható értékpapírok	43 103 502	24,43%	33 392 998	25,22%
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	46 867 216	26,56%	46 529 948	35,15%

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 szignifikáns változás nem következett be.

2019 első félévében továbbra is tartott az alap magyar állampapírokat, melyből az egyik lejárt. A felépített részvényportfóliója hazai és külföldi részvényeket tartalmazott, melyekben kisebb változtatásokat eszközültünk. Továbbá a befektetési alapoka közül az egyik származtatott alap súlyát csökkentettük. A nettó eszközérték csökkenése az alap befektetési jegyeiből való visszaváltások miatt következett be.

#### I.Egyéb információk

---

1.Az Alap 2019. évi első félévi költségeinek tételes kimutatását az alábbi táblázat tartalmazza:

	2019.06.28.
	eFt-ban
Alapkezelői díj	1683
Teljesítménydíj	852
Letétkezelői díj	34
Megbízási díj	50
Felügyeleti díj	21
Könyvvizsgálói díj	96
Bankköltség	20
Egyéb költség	55
Könyvelési díj	330
<b>Működési költség összesen</b>	<b>3139</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: 0 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 2019 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 egy 100%-ban részvényekből álló, kockázatosnak tekinthető portfólió elmúlt 5 éves szimulált heti hozamadatain alapszik. A kockázat/nyereség profil a múlttra vonatkozik, és szimulált adatokra épül, ezért nem tekinthető feltétlenül a jövőbeni kockázat/nyereség profil megbízható mutatójának. Az 1. kategóriába történő besorolás nem jelent kockázatmentes befektetést. 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 teljes egészében kockázatos eszközökbe, többek között hazai és külföldi részvényekbe, kötvényekbe, illetve határidős ügyletekbe fektetheti. 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.