

az

# **EQUILOR Private Wealth Management Származtatott 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 Private Wealth Management Származtatott Befektetési Alap (a továbbiakban: Alap) befektetési jegyeinek tulajdonosait a 2020. 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.

	2019.12.31		2020.06.30	
	HUF	NEÉ %-ában	HUF	NEÉ %-ában
Banki egyenlegek	38 226 457	70,90%	17 314 872	32,11%
Átruházható értékpapírok	52 977 268	98,26%	37 210 282	69,01%
Egyéb eszközök	65 196	-	890	-
Összes eszköz	91 268 921	169,27%	54 526 044	101,13%
Kötelezettségek	1 714 884	3,18%	608 208	1,13%
Nettó Eszközérték	89 554 037	100,00%	53 917 836	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):	51 403 826

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:	1,048907

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

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

	2019.12.31		2020.06.30	
	HUF	%	HUF	%
tőzsdén hivatalosan jegyzett, átruházható értékpapírok	33 281 944	37,16%	18 686 025	34,66%
más szabályzott piacon forgalmazott, átruházható értékpapírok	-	-	-	-
közelmúltban forgalomba hozott, átruházható értékpapírok	-	-	-	-
egyéb átruházható értékpapírok	19 695 324	21,99%	18 524 258	34,36%
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	-	-	-	-

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 az egyéb átruházható értékpapírok arányának csökkenésén kívül nem következett be.

#### I.Egyéb információk

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

	2020.06.30.
	eFt-ban
Alapkezelői díj	0
Teljesítménydíj	276
Letétkezelői díj	14
Megbízási díj	127
Felügyeleti díj	12
Könyvvizsgálói díj	96
Bankköltség	8
Egyéb költség	195
Könyvelési díj	356
<b>Működési költség összesen</b>	<b>1 084</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. (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 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 kockázat-nyereség mutatója: 4 (az 1 – 7 közötti skálán)

A kockázat/nyereség profil a múltira 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 4-es kockázati kategóriába történő kockázati besorolást az indokolja, hogy az Alap saját tőkét 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.

Equilor Alapkezelő Zrt.