

az

EQUILOR Progresszív 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



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 6. számú melléklete rendelkezéseinek megfelelően az alábbiakban tájékoztatja az EQUILOR Progresszív Származtatott Befektetési Alap (a továbbiakban: Alap) befektetési jegyeinek tulajdonosait a 2020. 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.

	2020.06.30	
	HUF	NEÉ %-ában
Banki egyenlegek	67 949 540	31,46%
Átruházható értékpapírok	153 445 662	71,04%
Egyéb eszközök	1 075 657	0,50%
Összes eszköz	222 470 859	103,00%
Kötelezettségek	6 486 737	3,00%
Nettó Eszközérték	215 984 122	100,00%

Az Alapot a Felügyelet 2020. március 31-én vette nyilvántartásba, ezért 2019. december 31-i adatok nem állnak rendelkezésre.

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):	200 000 000

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:	1,079921

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

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

	2020.06.30.	
	HUF	A nettó eszközérték %-ában
tőzsdén hivatalosan jegyzett, átruházható értékpapírok	121 766 910	56,38%
más szabályzott piacon forgalmazott, átruházható értékpapírok	0	0%
közelmúltban forgalomba hozott, átruházható értékpapírok	0	0%
egyéb átruházható értékpapírok	0	0%
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	31 678 752	14,67 %

Az Alapot a Felügyelet 2020. március 31-én vette nyilvántartásba, ezért 2019. december 31-i adatok nem állnak rendelkezésre.

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

Az alap eszközeit a befektetési politikájának megfelelően több eszközosztályokba fektette indulását követően. Ilyenek például hazai és külföldi részvényekbe, kötvényekbe állampapírokba, kollektív befektetési értékpapírokba (beleértve az ETF-eket is), illetve a határidős ügyletekbe. Az időszak végén az eszközértékének több, mint fele került tőzsdén jegyzett átruházható értékpapírokba befektetve.

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

	2020.06.30.
	eFt-ban
Alapkezelői díj	931
Sikerdíj	5 016
Letétkezelői díj	82
Megbízási díj	368
Felügyeleti díj	16
Könyvvizsgálói díj	118
Bankköltség	16
Egyéb költség	477
Könyvelési díj	191

Működési költség összesen

7 216

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: 95 123 807 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 a tárgyidőszakban értékpapír-finanszírozási ügyletet és teljeshozam-csereügyletet nem kötött.

Az Alap kockázat-nyereség mutatója: 5 (az 1 – 7 közötti skálán)

A kockázat/nyereség mutató az elmúlt 5 évben elért heti referenciahozam adatokat veszi alapul. 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 5-ös kockázati kategóriába történő kockázati besorolást az indokolja, hogy az Alap saját tőkéjét hazai és külföldi részvényekbe, kötvényekbe, illetve határidős ügyletekbe fekteti.

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.