

az

EQUILOR Fregatt Származtatott Alap

2021. első féléves jelentése

Dátum: 2021. augusztus 27.

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 Fregatt Származtatott Alap (a továbbiakban: Alap) befektetési jegyeinek tulajdonosait a 2021. év első félévének működési eredményéről.

Az EQUILOR Fregatt Származtatott Alap számszaki adatai

I. 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.

	2020.12.31		2021.06.30	
	HUF	NEÉ %-ában	HUF	NEÉ %-ában
Banki egyenlegek	26 073 565	22,08%	148 265 827	42,00%
Átruházható értékpapírok	97 965 087	82,95%	206 013 156	58,36%
Származékos ügyletek		0,00%	399 975	0,11%
Egyéb eszközök		0,00%	132 909	0,04%
Összes eszköz	124 038 652	105,03%	354 811 867	100,51%
Kötelezettségek	-5 937 632	-5,03%	-1 812 701	-0,51%
Nettó Eszközérték	118 101 020	100,00%	352 999 166	100,00%

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

II. A forgalomban levő befektetési jegyek száma

Tárgynap (T):	2021.06.30.
Darabszám (db):	291 349 991

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

III. Az egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

Tárgynap (T):	2021.06.30.
Egy jegyre jutó nettó eszközérték:	1,211598

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

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

	2020.12.31		2021.06.30	
	HUF	A nettó eszközérték %-ában	HUF	A nettó eszközérték %-ában
tőzsdén hivatalosan jegyzett, átruházható értékpapírok	35 633 528	30,17%	143 328 484	40,60%
más szabályzott piacon forgalmazott, átruházható értékpapírok				
közelmúltban forgalomba hozott, átruházható értékpapírok				
egyéb átruházható értékpapírok				
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	62 331 559	52,78%	62 684 672	17,76%

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 változás következett be. A tőzsdén hivatalosan jegyzett, átruházható értékpapírok esetében növekedés következett be, melynek során 30% körüli szintről 40% fölé emelkedett ezen eszközök teljes portfólióhoz viszonyított részaránya, ezzel szemben a hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok részaránya 52,8%-ról a harmadára csökkent.

Az Equilor Fregatt Származtatott Befektetési Alap eszközeit 2021 első félévében jellemzően részvényekben, külföldi államadósságot megtestesítő értékpapírokban, külföldi vállalatok által kibocsátott kötvényekben, külföldi devizákban (elsősorban euró és dollár) valamint kollektív befektetési formákban, úgy mint fejlett- és fejlődő piaci ETF-ekben tartotta.

Egyéb információk**1. Az Alap 2021. évi első félévi költségeinek tételes kimutatását az alábbi táblázat tartalmazza:**

	2021.06.30.
	eFt-ban
Alapkezelői díj	2 848
Teljesítménydíj	877
Letétkezelői díj	71
Megbízási díj	546
Felügyeleti díj	49
Könyvvizsgálói díj	95

Bankköltség	13
Forgalmazási díj	150
Egyéb költség	46
Könyvelési díj	371
Működési költség összesen	5 066

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: 69 077 653 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 2021 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 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 feltüntetett kockázati besorolás nem marad garantáltan változatlan, és az Alap kategorizálása idővel módosulhat. A jelentős kockázati besorolás annak köszönhető, hogy az Alap eszközeit nagyszámban részesedést megtestesítő értékpapírok jelentik.

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.