

EQUILOR DINAMIKUS PORTFOLIÓ SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP

Havi jelentés – 2017. június

Adatok zárása: 2017. június 30.

Általános információk

Típusa: nyilvános, nyíltvégű
Fajtája: abszolút hozamú alap
ISIN: HU0000715289
Deviza: HUF
Benchmark: 100% ZMAX index
Letétkezelő: Raiffeisen Bank Zrt.
Alapkezelői díj: 2%
Vételi megbízás elszámolása: T+2
Eladási megbízás elszámolása: T+3
Alap indulása: 2015. december 20.

Befektetési politika

Az Alap kifejezetten magas kockázatot vállaló, magas hozam potenciált kereső befektetők igényeit kívánja kielégíteni. Az Alap céljának elérése érdekében az Alap minden befektetési eszközre - kötvény, részvény, nyersanyag, deviza, származtatott termékek - felvehet akár vételi, akár eladási pozíciót.

Ajánlott befektetési időtáv: 1 - 3 év

Kockázati besorolás

alacsony közepes magas



Statistika indulástól

(2015.12.20)	Dinamikus
napi hozamok:	
átlaga	-0,016%
szórása	0,406%
évesítve	6,442%
hozamok:	
indulástól	-6,11%
évesítve	-4,04%
2017-ben	1,62%
egységnyi szórás (kockázat) hozama (évesített, indulástól)	
kockázatmentes hozam (ZMAX)	0,90%
évesítve (indulástól)	0,59%
többlethozam (évesítve, indulástól)	-4,63%
Sharpe mutató	-0,72%

Az alap hozamának alakulása indulástól



10%-ot meghaladó, illetve a három legnagyobb súlyú eszköz az alap eszköztétele százalékában

NÉV	Kitettség
Euró	26,03 %
Amerikai dollár	25,29 %
Magyar forint	16,94 %
Nettó összesített kockázati kitettség mértéke	143,05%

Árfolyam, nettó eszközérték és hozamok

1 jegyre jutó nettó eszközérték:	0,938855 Ft
Eszköztérték:	938 344 415 Ft

Időszak	1 hónap	3 hónap	2017-ben	Indulástól*
Hozam	-0,14%	-2,13%	1,62%	-4,04%
Benchmark	0,01%	0,04%	0,05%	0,59%

*évesített hozam

Kereskedelmi kommunikáció - Jogi nyilatkozata

Jelen kereskedelmi kommunikáció nem tekinthető ajánlattételnek, illetve befektetési vagy adózási tanácsadásnak. Befektetési döntése meghozatala előtt, kérjük, mérlegelje a befektetés tárgyát, kockázatát és díjait. Továbbá döntése meghozatala előtt kérjük, hogy figyelmesen tanulmányozza át a Kiemelt Befektetői Információt (KIID), valamint az Alap hivatalos Tájékoztatóját és Kezelési Szabályzatát. Az Alaphoz kapcsolódó Kiemelt Befektetői Információ és az Alap hivatalos Tájékoztatója és Kezelési Szabályzata az Alapkezelő www.eqa.hu honlapján, illetve a Felügyelet által üzemeltetett www.kozzetetelek.hu honlapon elérhető. A befektetési jegyek vezető forgalmazója, illetve letétkezelője a Raiffeisen Bank Zrt. rendelkezik a forgalmazói, illetve letétkezelői feladatok ellátásához szükséges személyi és tárgyi feltételekkel, hatósági engedéllyel. A tevékenység végzési engedély száma: 41.018/1998. valamint 41.018-3/1998. Az Alap alapkezelője az EQUILOR Alapkezelő Zrt., tevékenységét a Pénzügyi Szervezetek Állami Felügyelete a H-EN-III-1052/2012 számú határozatával engedélyezte. Jelen kiadvány a kollektív befektetési formákról és kezelőikről, valamint egyes pénzügyi tárgyú törvények módosításáról szóló 2014. évi XVI. törvény értelmében kereskedelmi kommunikációnak minősül. Jelen kiadvány nem teljes körű, a további részletekről, így az Alap befektetési politikájáról, a forgalmazási költségekről és a befektetés lehetséges kockázatairól szóló tájékoztatás megtalálható az Alap Tájékoztatójában és Kezelési szabályzatában a vezető forgalmazó, illetve a forgalmazó mindenkor aktuális kondíciós listájában és üzletszabályzatában, amelyek hozzáférhetőek a forgalmazási helyeken, valamint a vezető forgalmazó (www.raiffeisen.hu), illetve a Kezelési Szabályzat szerinti forgalmazók honlapján. Az Alaphoz kapcsolódó rendszeres tájékoztatási kötelezettségnek az Alap nevében az Alapkezelő köteles eleget tenni. Az éves és a féléves jelentések és a havi portfóliójelentések a közzétételi helyeken: az Alapkezelő honlapján: www.eqa.hu és a Felügyelet által üzemeltetett www.kozzetetelek.hu című honlapon elérhetőek.

EQUILOR DINAMIKUS PORTFOLIÓ SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP

Havi jelentés – 2017. június

Piacok			Portfólió összetétele		
Részvénypiacok 2017-ben					
ország	index	hozam			
USA	S&P 500	8,94%			
USA	S&P Midcap 400	1,71%			
USA	NASDAQ	1,73%			
USA	Russell 2000	3,56%			
EMU	EuroStoxx 50	1,05%			
Német	DAX	11,69%			
Brit	FTSE 100	5,67%			
Francia	CAC 40	9,89%			
Brazília	Bovespa	3,79%			
Kína	Shanghai	0,06%			
Japán	Nikkei 225	5,56%			
Lengyel	WIG 20	18,24%			
Cseh	PX index	9,14%			
Magyar	BUX	9,83%			
			Érték	Arány	
			Készpénz számlapénz	684 085 151 Ft	72,90%
			Állampapír	101 780 581 Ft	10,85%
			Vállalati kötvények	- Ft	0,00%
			Magyar és külföldi részvények	153 159 414 Ft	16,32%
			Származtatott ügyletek eredménye	- Ft	0,00%
			Kollektív befektetési értékpapírok	- Ft	0,00%
			Kötelezettség	43 306 227 Ft	-4,62%
			Követelés	44 773 140 Ft	4,77%
			Költségek	2 147 644 Ft	-0,23%
			Teljes nettó eszközérték	938 344 415 Ft	100,00%

Alapkezelői beszámoló

Az Equilor Dinamikus alap májusi lejtmenete és gyengébb teljesítménye június hónapra normalizálódott és nulla közeli eredményt értünk el. Alapunk továbbra is nyögi a rendületlen HUF erőt, azonban továbbra is hiszünk, hogy a magyar fizetőeszköz ereje csak átmeneti.

Bár voltak jó befektetések júniusban is, sem a devizapiacra, sem a részvénytőzsdén nem tudtuk átütő eredményt elérni egyetlen eszközcsoportban sem. Továbbra is bízunk egy komolyabb nyersanyag rallyban, és tartjuk a rézzel és olajjal szorosan együttmozgó amerikai részvényeinket.

Júniusban bővítettük részvény portfóliónkat a frissen kibocsátott Waberers részvénnyel, valamint az amerikai MEET US-ben látunk érdemi árfolyam növekedést.

Kereskedelmi kommunikáció - Jogi nyilatkozata

Jelen kereskedelmi kommunikáció nem tekinthető ajánlattételnek, illetve befektetési vagy adózási tanácsadásnak. Befektetési döntése meghozatala előtt, kérjük, mérlegelje a befektetés tárgyát, kockázatát és díjait. Továbbá döntése meghozatala előtt kérjük, hogy figyelmesen tanulmányozza át a Kiemelt Befektetői Információt (KIID), valamint az Alap hivatalos Tájékoztatóját és Kezelési Szabályzatát. Az Alaphoz kapcsolódó Kiemelt Befektetői Információ és az Alap hivatalos Tájékoztatója és Kezelési Szabályzata az Alapkezelő www.eqa.hu honlapján, illetve a Felügyelet által üzemeltetett www.kozzetetelek.hu honlapon elérhető. A befektetési jegyek vezető forgalmazója, illetve letétkezelője a Raiffeisen Bank Zrt. rendelkezik a forgalmazói, illetve letétkezelői feladatok ellátásához szükséges személyi és tárgyi feltételekkel, hatósági engedéllyel. A tevékenység végzési engedély száma: 41.018/1998. valamint 41.018-3/1998. Az Alap alapkezelője az EQUILOR Alapkezelő Zrt., tevékenységét a Pénzügyi Szervezetek Állami Felügyelete a H-EN-III-1052/2012 számú határozatával engedélyezte. Jelen kiadvány a kollektív befektetési formákról és kezelőikről, valamint egyes pénzügyi tárgyú törvények módosításáról szóló 2014. évi XVI. törvény értelmében kereskedelmi kommunikációnak minősül. Jelen kiadvány nem teljes körű, a további részletekről, így az Alap befektetési politikájáról, a forgalmazási költségekről és a befektetés lehetséges kockázatairól szóló tájékoztatás megtalálható az Alap Tájékoztatójában és Kezelési szabályzatában a vezető forgalmazó, illetve a forgalmazó mindenkor aktuális kondíciós listájában és üzletszabályzatában, amelyek hozzáférhetőek a forgalmazási helyeken, valamint a vezető forgalmazó (www.raiffeisen.hu), illetve a Kezelési Szabályzat szerinti forgalmazók honlapján. Az Alaphoz kapcsolódó rendszeres tájékoztatási kötelezettségnek az Alap nevében az Alapkezelő köteles eleget tenni. Az éves és a féléves jelentések és a havi portfóliójelentések a közzétételi helyeken: az Alapkezelő honlapján: www.eqa.hu és a Felügyelet által üzemeltetett www.kozzetetelek.hu című honlapon elérhetőek.