

# EQUILOR HYDRA SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP

Havi jelentés – 2018.október

Adatok zárása: 2018. október 31.

## Általános információk

Típusa: nyilvános, nyíltvégű  
Fajtája: abszolút hozamú származtatott alap  
ISIN: HU0000719612  
Bloomberg:  
Deviza: HUF  
Benchmark: 100% ZMAX index  
Letétkezelő: Raiffeisen Bank Zrt.  
Alapkezelői díj: 2,0%  
Elszámolási nap - vétel: T+2  
Elszámolási nap - eladás: T+3  
Alap indulása: 2017. december 19.

## Befektetési politika

Az Equilor Hydra alap célja, hogy magasabb kockázat vállalása mellett a bankbetétek hozamát jelentős mértékben meghaladó hozamot érjen el. Ennek érdekében az Alap aktívan kezelt portfólió kialakítását tűzte ki célul, melynek kialakítása során az Alap minden a tőkepiacokon elérhető befektetési eszközre –részvény, kötvény, nyersanyag, deviza, származtatott termékek- felvehet akár vételi akár eladási pozíciót is. Az Alapnak a hagyományos befektetési alapokkal ellentétben nem csak emelkedő, hanem adott esetben csökkenő piacokon is lehetősége van profitot realizálni.

Ajánlott befektetési időtáv: **minimum 3 év**

alacsony közepes magas

## Kockázati besorolás

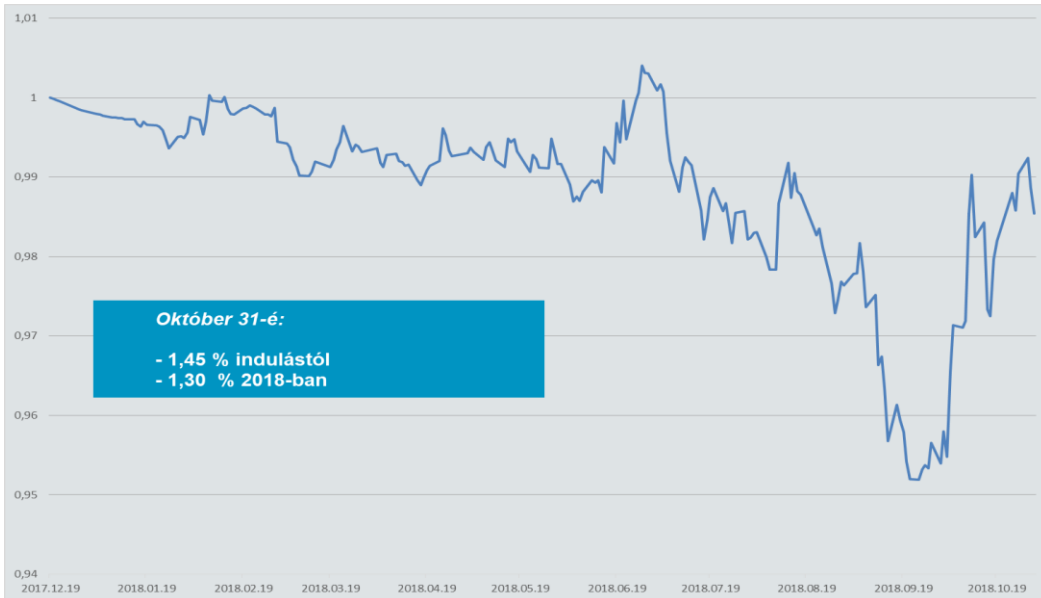
1 2 3 4 5 6 7

## Statiszitika indulástól

(2017.12.19)	<b>Hydra</b>
napi hozamok:	
átlaga	-0,006%
szórása	0,289%
évesítve	4,580%
hozamok:	
indulástól	-1,45%
évesítve	N/A
2018-ban	-1,30%
<b>Évek</b>	<b>Hozam*</b>
2017	-0,15%

\*Nettó hozamok

## Az alap hozamának alakulása indulástól



10%-ot meghaladó, illetve az öt legnagyobb súlyú eszköz az alap eszköztárában

Név	Kitettség
HUF	45,13 %
EUR	14,31 %
ESZ8 E-mini S&P 500 short	12,64 %
PSQ –Proshares Nasdaq Ultrashort ETF	7,42 %
USD	6,32 %
<b>Nettó összesített kockázati kitettségi mértéke</b>	<b>123,54%</b>

## Árfolyam, nettó eszközérték és hozamok

1 jegyre jutó nettó eszközérték: 0,985457 Ft  
Eszközérték: 614 188 870 Ft

Időszak	1 hónap	3 hónap	2018-ban	Indulástól*
Hozam	3,02%	0,34%	-1,30%	-1,45%
Benchmark	-0,02%	0,06%	0,07%	0,07%

\*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](http://www.eqa.hu) honlapján, illetve a Felügyelet által üzemeltetett [www.kozzetetelek.hu](http://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 mindenkori aktuális kondíciós listájában és üzletszabályzatában, amelyek hozzáférhetőek a forgalmazási helyeken, valamint a vezető forgalmazó ([www.raiffeisen.hu](http://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](http://www.eqa.hu) és a Felügyelet által üzemeltetett [www.kozzetetelek.hu](http://www.kozzetetelek.hu) című honlapon elérhetőek.

Equilor Alapkezelő Zrt. • 1037 Budapest, Montevideo u. 2/C

Telefon: (36 1) 808 9250 • Fax: (36 1) 808 9251 • [info@eqa.hu](mailto:info@eqa.hu) • [www.eqa.hu](http://www.eqa.hu)

# EQUILOR HYDRA SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP

Havi jelentés – 2018. október

## Piacok

### Részvénytőpiacok 2018-ban

ország	index	hozam
USA	S&P 500	1,43%
USA	S&P Midcap 400	-3,97%
USA	NASDAQ	5,83%
USA	Russell 2000	-1,57%
EMU	EuroStoxx 50	-8,75%
Német	DAX	-11,38%
Brit	FTSE 100	-7,28%
Francia	CAC 40	-4,12%
Brazília	Bovespa	14,43%
Kína	Shanghai	-21,30%
Japán	Nikkei 225	-3,71%
Lengyel	WIG 20	-12,57%
Cseh	PX index	-1,07%
Magyar	BUX	-5,64%

## Portfólió összetétel

	Érték	Arány
Készpénz számlapénz	404 397 707 Ft	65,84%
Állampapír	28 365 314 Ft	4,62%
Magyar és külföldi részvények	40 675 576 Ft	6,62%
Származtatott ügyletek eredménye	- 393 043 Ft	-0,06%
Követelés	36 086 Ft	0,01%
Kötelezettség	- 348 262 Ft	-0,06%
Költségek	- 1 394 175 Ft	-0,23%
Kollektív befektetési értékpapírok	142 849 667 Ft	23,26%
<b>Teljes nettó eszközérték</b>	<b>614 188 870 Ft</b>	<b>100%</b>

## Alapkezelői beszámoló

Az Alap hozama októberben 3,02 százalék volt, amely eredmény a short határidős pozícióknak, a volatilitás longunknak illetve a 4IG részvényben nyitott és le is zárt vételi pozíciónak volt köszönhető. A főbb nemzetközi indexek mind 5 százalék feletti mínuszokkal zárták a hónapot. A következő időszakra vonatkozóan továbbra is bizonytalanságot és volatilis kereskedést vár az alap kezelője a nemzetközi részvénytőpiacokon.

### 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](http://www.eqa.hu) honlapján, illetve a Felügyelet által üzemeltetett [www.kozzetetelek.hu](http://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](http://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](http://www.eqa.hu) és a Felügyelet által üzemeltetett [www.kozzetetelek.hu](http://www.kozzetetelek.hu) című honlapon elérhetőek.