

EQUILOR MAGNUS EUR SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP

Havi jelentés – 2016. november

Adatok zárása: 2016. november 30.

Általános információk

Típusa: nyilvános, nyíltvégű
Fajtája: abszolút hozamú alap
ISIN: HU0000714761
Deviza: EUR
Benchmark: EFFAS Eurobond Bond 1-3 Year Index (EUR-ban)
Letétkezelő: Raiffeisen Bank Zrt.
Alapkezelői díj: 2,0%
Elszámolási nap - vétel: T +2
Elszámolási nap - eladás: T +3
Alap indulása: 2015.06.17.

Befektetési politika

Az Alap célja, hogy a pénz- és tőkepiacok által adott lehetőségeken belül, megfelelő kockázatkezeléssel, valamint befektetési eszközök kiválasztásával a bankbetéteknél magasabb hozamot biztosítson a befektetők számára. Ennek érdekében az Alap aktív portfólió kezelést folytat és alkalmazkodik a mindenkori piaci viszonyokhoz.

Minimálisan ajánlott befektetési időtáv: 5 év

Kockázati besorolás



Statistika indulástól

| | |
|---------------|---------------|
| (2015.06.17) | Magnus |
| napi hozamok: | |
| átlaga | -0,008% |
| szórása | 0,148% |
| évesítve | 2,353% |

| | |
|------------|--------|
| hozamok: | |
| indulástól | -3,58% |
| évesítve | -2,47% |
| 2016-ban | -1,42% |

| | |
|--|--------|
| egységnyi szórás (kockázat) hozama (évesített, indulástól) | -1,05% |
| kockázatmentes hozam (EONIA) | -0,37% |
| évesítve (indulástól) | -0,25% |
| többlethozam (évesítve, indulástól) | -2,22% |
| Sharpe mutató | -0,94% |

Az Alap hozamának alakulása indulástól



november 30.-án:

-3,58% indulástól
-1,42% 2016-ban

*Az idősr rövidsége miatt ezen értékek nem mutatnának reális képet a valóságról.

Az első négy legnagyobb súlyú eszköz

| Név | Kitettség |
|----------------------------|-------------|
| Pénzeszközök | 47,54% |
| 2018/A magyar államkötvény | 20,26% |
| 2017/A magyar államkötvény | 6,09% |
| Magyar devizakötvény | 9,19% |
| Kockázati kitettség | 100% |

Árfolyam, nettó eszközérték és hozamok

| | | | | |
|----------------------------------|----------------|----------------|-----------------|-------------------|
| 1 jegyre jutó nettó eszközérték: | 0,009641 EUR | | | |
| Eszközérték: | 639 906 EUR | | | |
| Időszak | 1 hónap | 3 hónap | 2016-ban | Indulástól |
| Hozam | 0,01% | -0,30% | -1,42% | -3,58% |
| Benchmark | 0,02% | -0,11% | 0,19% | 0,76% |

Kereskedelmi kommunikáció - Jogi nyilatkozata

Jelen kereskedelmi kommunikáció nem tekinthető ajánlattételnek, illetve befektetési vagy adózási tanácsadásnak. Befektetési döntése meghozatala előtt, kérjük, mérlelje a befektetés tárgyát, kockázatát, díjait és a befektetésekből származó esetleges károkat. Továbbá döntése meghozatala előtt kérjük, hogy figyelmesen tanulmányozza át a Pénzügyi Szervezetek Állami Felügyelete által jóváhagyott Kiemelt Befektetői Információt (KIID), valamint az Alap hivatalos Tájékoztatóját és Kezelési Szabályzatát. Az Alaphoz kapcsolódó jóváhagyott 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 befektetési jegyeinek további forgalmazója az EQUILOR Befektetési Zrt. (Engedélyszám: ÁPTF 73.051/1998.) 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), illetve a forgalmazó (www.equilor.hu) 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 MAGNUS EUR SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP

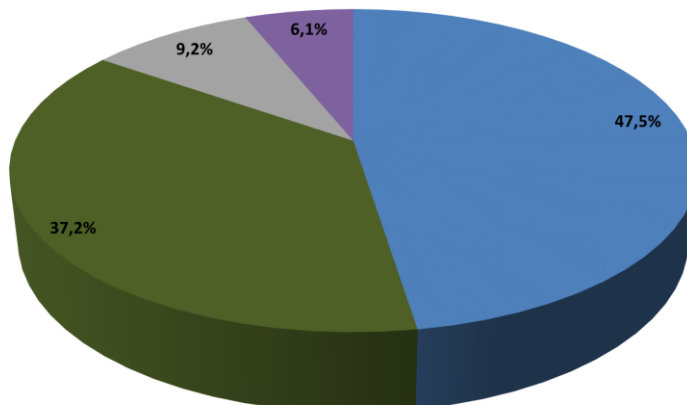
Havi jelentés – 2016. november

Piacok

Részvénypiacok 2016-ban

| ország | index | hozam |
|----------|----------------|--------|
| USA | S&P 500 | 7,58% |
| USA | S&P Midcap 400 | 7,82% |
| USA | NASDAQ | 2,59% |
| USA | Russell 2000 | 16,41% |
| EMU | EuroStoxx 50 | -0,12% |
| Német | DAX | -0,96% |
| Brit | FTSE 100 | 8,67% |
| Francia | CAC 40 | -1,27% |
| Brazília | Bovespa | 42,81% |
| Kína | Shanghai | -8,17% |
| Japán | Nikkei 225 | -3,81% |
| Lengyel | WIG 20 | -3,28% |
| Cseh | PX index | -7,85% |
| Magyar | BUX | 25,47% |

Eszközök megoszlása



- Pénzeszközök
- Magyar forint állampapírok
- Magyar devizás állampapírok
- Részvények

Alapkezelői beszámoló

Az amerikai elnökválasztás első reakciója negatívan érte a piacokat, de végül mégis pozitív hozadéka lett Donald Trump győzelmének. Ennek megfelelően a piacok mintha kissé túlvetté váltak volna ezért EUR korrekcióra rendezkedett be az alap, a magyar és külföldi devizák relatív értékeltségen keresztül. Részvény pozícióit a nagyobb árfolyammozgásokban zárta, célárra futottak.

Jelenlegi legnagyobb súlyal rendelkező részvénykitettséünk a Kuka Ag. részvényeiben nyilvánul meg, mely mögött egy potenciális felvásárlás áll. Úgy ítéljük meg, hogy továbbra is kedvező kimenetelre számíthatunk ezzel kapcsolatban, ezért a tartás mellett tettük le a voksunkat.

Az alap mostantól befektetési döntéseinek támogatására, mesterséges intelligencia alapú előrejelzésekre is támaszkodik. Ezek az előrejelzések olyan matematikai modellekre hagyatkoznak, amelyek kapcsolatokat keresnek több részvény, index és árutözsdei termék mozgása között és a felfedezett ismétlődő minták segítségével adnak előrejelzéseket.

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, díjait és a befektetésekből származó esetleges károkat. Továbbá döntése meghozatala előtt kérjük, hogy figyelmesen tanulmányozza át a Pénzügyi Szervezetek Állami Felügyelete által jóváhagyott Kiemelt Befektetői Információt (KIID), valamint az Alap hivatalos Tájékoztatóját és Kezelési Szabályzatát. Az Alaphoz kapcsolódó jóváhagyott 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 befektetési jegyeinek további forgalmazója az EQUILOR Befektetési Zrt. (Engedélyszám: ÁPTF 73.051/1998.) 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 forgalmazó (www.equilor.hu) 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.