

EQUILOR MAGNUS EUR SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP

Havi jelentés – 2017. június

Adatok zárása: 2017. június 30.

Általános információk

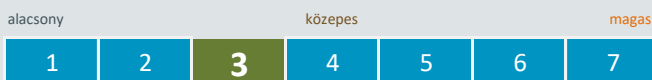
Típusa: nyilvános, nyíltvégű
Fajtája: abszolút hozamú alap
ISIN: HU0000714761
Deviza: EUR
Benchmark: Az Alap referenciahozama 2017. június 28-ig: 100% EFFASEurobond 1-3y Index
Az Alap referenciahozama 2017. június 29-től: 100% Bloomberg Barclays Series-E Euro Govt 1-3Yr Bond Index
Letétkezelő: Raiffeisen 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



Statisztika indulástól

(2015.06.17)	Magnus
napi hozamok:	
átlaga	-0,009%
szórása	0,183%
évesítve	2,898%
hozamok:	
indulástól	-4,32%
évesítve	-2,14%
2017-ben	-2,31%
egységnyi szórás (kockázat) hozama (évesített, indulástól)	-0,74%
kockázatmentes hozam (EONIA)	-0,57%
évesítve (indulástól)	-0,28%
többlet hozam (évesítve, indulástól)	-1,86%
Sharpe mutató	-0,64%

Az Alap hozamának alakulása indulástól



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

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

Név	Kitettség
Pénzeszközök	52,72%
2018/A magyar államkötvény	21,61%
2018/A magyar államkötvény	11,80%
Nettó összesített kockázati kitettség mértéke	115,22%

Árfolyam, nettó eszközérték és hozamok

1 jegyre jutó nettó eszközérték:	0,009567 EUR			
Eszközérték:	580 842 EUR			
Időszak	1 hónap	3 hónap	2017-ben	Indulástól
Hozam	-1,23%	-2,17%	-2,31%	-4,32%
Benchmark	-0,16%	0,04%	-0,29%	0,67%

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 mindenkori 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 MAGNUS EUR SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP

Havi jelentés – 2017. június



Piacok

Részvénypiacok 2017-ben

ország	index	hozam
USA	S&P 500	8,24%
USA	S&P Midcap 400	1,45%
USA	NASDAQ	-0,94%
USA	Russell 2000	4,29%
EMU	EuroStoxx 50	-3,17%
Német	DAX	7,35%
Brit	FTSE 100	2,38%
Francia	CAC 40	5,31%
Brazília	Bovespa	4,44%
Kína	Shanghai	2,86%
Japán	Nikkei 225	4,81%
Lengyel	WIG 20	18,06%
Cseh	PX index	6,38%
Magyar	BUX	10,01%

Portfólió összetétele

	Érték	Arány
Készpénz számlapénz	327 956 €	56,46%
Állampapír	194 086 €	33,41%
Magyar és külföldi részvények	44 494 €	7,66%
Származtatott ügyletek eredménye	0 €	0,00%
Követelés	0 €	0,00%
Kötelezettség	-21 759 €	-3,75%
Költségek	-500 €	-0,09%
Kollektív befektetési értékpapírok	36 563 €	6,29%
Korrekción	0 €	0,00%
Teljes nettó eszközérték	580 841 €	100,00%

Alapkezelői beszámoló

A júniusi hónap megnövekedett volatilitás mellett telt és sajnos az alap szempontjából negatívnak volt mondható. Mario Draghi EKB elnök egy konferencián utalt a jó gazdasági növekedésre és egy esetleges tapering-re, melyre a piacok elég markánsan reagáltak. Az alap egy hosszabb távú USD erősödéssel volt berendezkedve, mint az euró, mind a forinttal szemben, így az EURUSD-ből a USD indexbe is átgyűrűzött a dollár gyengeség, ami a forrása a negatív teljesítménynek. Mindazonáltal, úgy gondoljuk, hogy ez egy túlreakció, hiszen érdemben nem változott a makro környezet és az EKB is később próbált korrigálni a kommunikációján. Viszont a EKB oldaláról a kockázatok kiegyensúlyozottak és nem látnak deflációs veszélyt. Egy korrekcióban a pozíciókat ugyanakkor csökkenteni tervezzük.

Fontos megemlíteni, hogy az alap benchmarkja, külső okok miatt megváltozott. A Bloomberg EFFAS index családját konzisztenssé tette a Bloomberg Barclays index családjával, így megszűnt a korábbi EFFAS benchmarkunk. Az új benchmark az átalakított EFFAS 1-3y EUR Gov Bond index, mostantól a Bloomberg Barclays 1-3y EUR Gov Bond névre hallgat, melyben minimális számításműveleti változások vannak. A váltásról honlapunkon közleményben értesítettük befektetőinket június 29-én.

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.