

EQUILOR MAGNUS EUR SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP

Havi jelentés – 2017. december

Adatok zárása: 2017. december 29.

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

alacsony közepes magas

1 2 3 4 5 6 7

Statistika indulástól

| | |
|---------------|---------------|
| (2015.06.17) | Magnus |
| napi hozamok: | |
| átlaga | -0,006% |
| szórása | 0,222% |
| évesítve | 3,520% |
| hozamok: | |
| indulástól | -3,72% |
| évesítve | -1,48% |
| 2017-ben | -1,70% |
| Évek | Hozam* |
| 2015 | -2,20% |
| 2016 | 0,13% |
| 2017 | -1,70% |

*Nettó hozamok

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 eszköztáráé százalékában

| Név | Kitettség |
|--|----------------|
| Pénzeszközök | 13,07% |
| 2018/A magyar államkötvény | 25,34% |
| 2018/C magyar államkötvény | 14,56% |
| Nettó összesített kockázati kitettség mértéke | 117,23% |

Árfolyam, nettó eszközérték és hozamok

| 1 jegyre jutó nettó eszközérték: | 0,009627 EUR | | | |
|----------------------------------|--------------|---------|----------|-------------|
| Eszközérték: | 469 581 EUR | | | |
| Időszak | 1 hónap | 3 hónap | 2017-ben | Indulástól* |
| Hozam | -0,06% | 0,98% | -1,70% | -1,48% |
| Benchmark | -0,19% | -0,12% | -0,31% | 0,65% |

*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 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. december



Piacok

Részvénypiacok 2017-ben

| ország | index | hozam |
|----------|----------------|--------|
| USA | S&P 500 | 19,42% |
| USA | S&P Midcap 400 | 0,07% |
| USA | NASDAQ | 0,43% |
| USA | Russell 2000 | 13,14% |
| EMU | EuroStoxx 50 | -1,85% |
| Német | DAX | 12,51% |
| Brit | FTSE 100 | 7,63% |
| Francia | CAC 40 | 9,26% |
| Brazília | Bovespa | 26,86% |
| Kína | Shanghai | 6,56% |
| Japán | Nikkei 225 | 19,10% |
| Lengyel | WIG 20 | 26,35% |
| Cseh | PX index | 16,99% |
| Magyar | BUX | 23,04% |

Portfólió összetétele

| | Érték | Arány |
|------------------------------------|------------------|----------------|
| Készpénz számlapénz | 61 258 € | 13,05% |
| Állampapír | 187 331 € | 39,89% |
| Magyar és külföldi részvények | 0 € | 0,00% |
| Származtatott ügyletek eredménye | 8 185 € | 1,74% |
| Követelés | 98 € | 0,02% |
| Kötelezettség | 0 € | 0,00% |
| Költségek | -2 058 € | -0,44% |
| Kollektív befektetési értékpapírok | 214 766 € | 45,74% |
| Korrekción | -0 € | 0,00% |
| Teljes nettó eszközérték | 469 581 € | 100,00% |

Alapkezelői beszámoló

Az év utolsó hónapját, az alap -0,06%-al fejezte be. Az alapon lévő ETF komponensek a modellünknek megfelelően viselkednek, ezért ott változtatásokat nem hajtottunk végre. A nyitva lévő EURUSD call opciókat ebben a hónapban még nem kötjük át, de mivel értéke egyre gyorsabban csökken, a jövő hónapban a profitot realizáljuk rajta és átkötjük.

Az ETF-ekben osztalékfizetésekre számítunk, melyek jóváíródása a következő évre csúszik, de az egyik komponens, mely szintén egy kvantitatív modell alapján időzíti az USA részvénypiacát, egy nagyobb osztalékot tervez fizetni, ami az alapunkra jó hatással lesz.

Modelljeink jelenleg trendkövető üzemmódban futnak. Úgy gondoljuk, hogy a következő évben a trendkövetés/momentum lehet a jó stratégia, mert érték alapon jelenleg nagyon nehéz vonzó befektetéseket találni.

Fontos megemlíteni, hogy az alap benchmarkja, külső okok miatt megváltozott. A Bloomberg EFFAS index családját konzisztenssége miatt 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 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.