

EQUILOR PILLARS SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP

Havi jelentés – 2017 október

Adatok zárása: 2017. október 31.

Általános információk

Típusa: nyilvános, nyíltvégű
Fajtája: abszolút hozamú alap
ISIN: HU0000711791
Bloomberg: EQAPILL HB Equity
Deviza: HUF
Benchmark: RMAX index
Letétkezelő: Raiffeisen Bank Zrt.
Alapkezelői díj: 2,0%
Elszámolási nap - vétel: T+2
Elszámolási nap - eladás: T+3
Alap indulása: 2012. december 5.

Befektetési politika

Az alap célja az, hogy a piaci körülményektől függetlenül (emelkedő, eső, oldalazó piac) a magyar kockázatmentes hozamot jelentős mértékben meghaladja. Ezen cél elérésének érdekében folyamatosan vizsgálja a három fő piaci szegmens (részvény-, deviza- és áru) állapotát, és a statisztikai, fundamentális és technikai elemzések alapján határozza meg az adott piaci szegmens befektetéseiben való részesedésének súlyát.

Ajánlott befektetési időtáv: 1 - 3 év

Kockázati besorolás

alacsony közepes magas

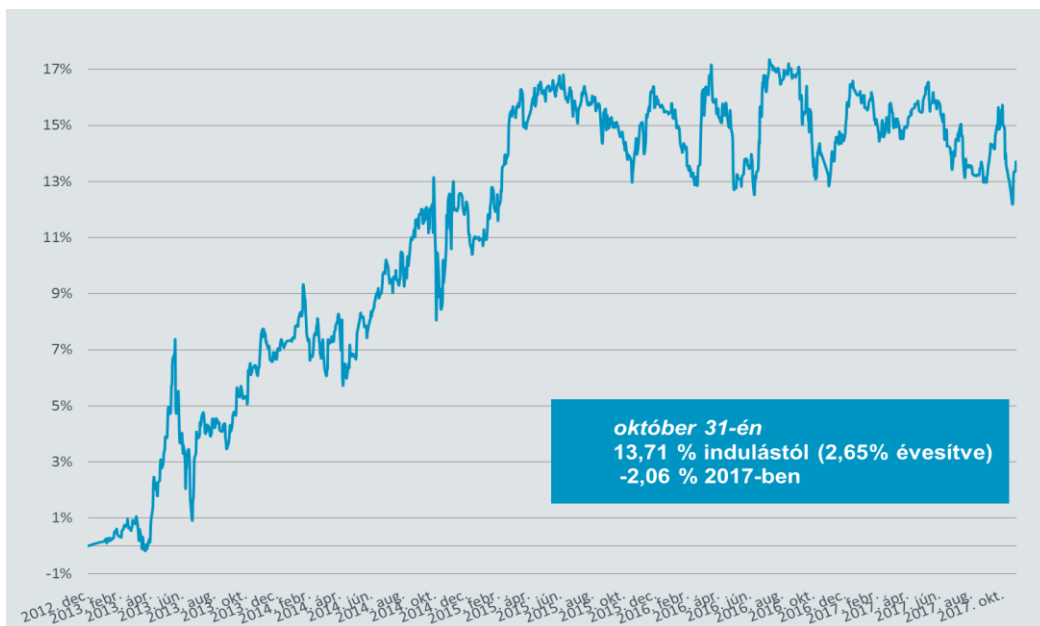
1 2 3 4 5 6 7

Statisztika indulástól

| | |
|---------------|----------------|
| (2012.12.05) | Pillars |
| napi hozamok: | |
| átlaga | 0,011% |
| szórása | 0,307% |
| évesítve | 4,868% |
| hozamok: | |
| indulástól | 13,71% |
| évesítve | 2,65% |
| 2017-ben | -2,06% |
| Évek | Hozam* |
| 2012 | 0,13% |
| 2013 | 7,21% |
| 2014 | 3,34% |
| 2015 | 4,04% |
| 2016 | 0,58% |

*Nettó hozamok

Az alap hozamának alakulása indulástól



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

| Név | Kitettség |
|--|----------------|
| Euró | 14,92% |
| MSCI Columbia ETF | 10,36% |
| REPHUF 5,75 USD kötvény | 9,45% |
| Nettó összesített kockázati kitettségek mértéke | 105,55% |

Árfolyam, nettó eszközérték és hozamok

1 jegyre jutó nettó eszközérték: 1,138153 Ft
Eszközérték: 666 691 699 Ft

| Időszak | 1 hónap | 3 hónap | 2017-ben | Indulástól* |
|-----------|---------|---------|----------|-------------|
| Hozam | -1,01% | 0,10% | -2,06% | 2,65% |
| Benchmark | -0,01% | 0,07% | 0,18% | 2,55% |

*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 (KIIF), 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 kondíciók 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 PILLARS SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP

Havi jelentés – 2017. október



Piacok

Részvénypiacok 2017-ben

| ország | index | hozam |
|----------|----------------|--------|
| USA | S&P 500 | 15,03% |
| USA | S&P Midcap 400 | 2,18% |
| USA | NASDAQ | 3,57% |
| USA | Russell 2000 | 10,73% |
| EMU | EuroStoxx 50 | 2,20% |
| Német | DAX | 15,23% |
| Brit | FTSE 100 | 4,90% |
| Francia | CAC 40 | 13,18% |
| Brazília | Bovespa | 23,38% |
| Kína | Shanghai | 9,33% |
| Japán | Nikkei 225 | 15,16% |
| Lengyel | WIG 20 | 29,62% |
| Cseh | PX index | 15,62% |
| Magyar | BUX | 23,77% |

Portfólió összetétele

| | Érték | Arány |
|------------------------------------|-----------------------|----------------|
| Szabványos opciók | 3 513 032 Ft | 0,53% |
| Készpénz számlapénz | 157 126 854 Ft | 23,57% |
| Állampapír | 123 872 169 Ft | 18,58% |
| Vállalati kötvények | - Ft | 0,00% |
| Magyar és külföldi részvények | 299 139 103 Ft | 44,87% |
| Kollektív befektetési értékpapírok | 111 444 689 Ft | 16,72% |
| Származtatott ügyletek eredménye | - 10 612 055 Ft | -1,59% |
| Kötelezettség | - 17 489 367 Ft | -2,62% |
| Követelés | - Ft | 0,00% |
| Költségek | - 302 726 Ft | -0,05% |
| Teljes nettó eszközérték | 666 691 699 Ft | 100,00% |

Alapkezelői beszámoló

Az Equilor Pillars alapunk októberben szerény eredményt ért el, és -1% hozammal zárta a hónapot. Az ősz második hónapját arra használtuk, hogy a kevésbé működő befektetési eszközeinktől megváljunk, amelyek felelősek az enyhe hozam visszaesésért. Például likvidáltuk az alul teljesítő kolumbiai részvény piacot reprezentáló ETF-et, a GXG US-t, és a német bank papírjainkat is. Mindemellett októberben megváltunk a gyengélkedő magyar gyógyszeripari óriástól is, a Richtertől. Szabványos opciókkal bővítettük a befektetési palettánkat, és az SP500-on „Terpezs”-t vásároltunk, abban bízva az amerikai részvényindex volatilitása a következő hetekben jelentősen megugrik.

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.