

EQUILOR FREGATT PRÉMIUM KÖTVÉNY BEFEKTETÉSI ALAP

Havi jelentés – 2018. augusztus



Adatok zárása: 2018. augusztus 31.

Általános információk

Típusa: nyilvános, nyíltvégű
Fajtája: kötvényalap
ISIN: HU0000711783
Bloomberg: EQAFREG HB Equity
Deviza: HUF
Benchmark: 80% CMAX + 20% S&P Eurozone Government Bond 1-3y (HUF)
Letétkezelő: Raiffeisen Bank Zrt.
Alapkezelői díj: 1,5%
Elszámolási nap: T+2
Alap indulása: 2012. december 5.

Befektetési politika

Az alap fő célja, hogy korlátozott kockázat felvállalása mellett a kockázatmentes magyar hozamot jelentős mértékben meghaladja. Az alapot elsősorban azoknak a befektetőknek ajánljuk, akik legalább 1 évre szeretnék pénzüket elhelyezni mérsékelt kockázat mellett egy túlnyomó részben hazai állampapírokból, betétekből, vállalati kötvényekből álló befektetésben.

Ajánlott befektetési időtáv: 1 - 3 év

Kockázati besorolás

alacsony közepes magas

1 2 3 4 5 6 7

Statistika indulástól

(2012.12.05)	Fregatt
napi hozamok:	
átlaga	0,012%
szórása	0,214%
évesítve	3,396%
hozamok:	
indulástól	17,63%
évesítve	2,87%
2018-ban	0,12%
Évek	Hozam*
2012	0,17%
2013	8,96%
2014	7,92%
2015	1,77%
2016	2,48%
2017	-4,35%

*Nettó hozamok

Az alap hozamának alakulása indulástól



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

NÉV	Kitettség
US Treasury 03/2019	31,53%
HUF	21,70%
Bund 2X short ETF	18,37%
Nettó összesített kockázati kitettségi mértéke	100,00%

Árfolyam, nettó eszközérték és hozamok

1 jegyre jutó nettó eszközérték:	1,177474 Ft			
Eszközérték:	70 106 386 Ft			
Időszak	1 hónap	3 hónap	2018-ban	Indulástól*
Hozam	-0,26%	-0,11%	0,12%	2,87%
Benchmark	0,05%	-0,33%	-1,77%	5,78%

* Évesített

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 díját. 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.

EQUILOR FREGATT PRÉMIUM KÖTVÉNY BEFEKTETÉSI ALAP

Havi jelentés – 2018. augusztus



Piacok			Portfólió összetétele		
Részvénypiacok 2018-ban					
ország	index	hozam			
USA	S&P 500	8,52%			
USA	S&P Midcap 400	7,58%			
USA	NASDAQ	17,47%			
USA	Russell 2000	13,37%			
EMU	EuroStoxx 50	-3,17%			
Német	DAX	-4,29%			
Brit	FTSE 100	-3,32%			
Francia	CAC 40	1,77%			
Brazília	Bovespa	0,36%			
Kína	Shanghai	-17,60%			
Japán	Nikkei 225	0,44%			
Lengyel	WIG 20	-5,01%			
Cseh	PX index	-0,49%			
Magyar	BUX	-5,44%			
			Érték	Arány	
			Készpénz számlapénz	37 379 479 Ft	53,18%
			Állampapír	20 662 934 Ft	29,40%
			Kollektív befektetési értékpapírok	12 956 376 Ft	18,43%
			Kötelezettség	- 190 500 Ft	-0,27%
			Költségek	- 519 974 Ft	-0,74%
			Korrekción	- Ft	0,00%
			Teljes nettó eszközérték	70 288 315 Ft	100,00%

Alapkezelői beszámoló

Az alap augusztusban növelte dollár kitétségét és féléves lejáratú amerikai T-billt vásárolt eszközértékének 30%-a erejéig abbéli megfontolásból, hogy megfelelőnek találja ezen eszközökön elérhető közel 2%-os hozamot a hazai hasonló futamidejű eszközökön realizálható néhány 10 bázispontossal szemben, valamint ugyanebből a megfontolásból bízott a carry forintra gyakorolt nyomásában az amerikai dollárral szemben.

Alapvetően a rövid, valamint short kötvény típusú eszközök tartása és a megnövelt devizális eszközökön keresztüli forint gyengülés tette lehetővé a benchmarkját mintegy 2%-al meghaladó –hazai kötvény alap rangsorban unikálisnak számító - pozitív abszolút hozam kimutathatóságát az idei év során, mely a Fregatt alapot a szabad futamidejű kategóriában az élvonalba repítette.

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.