

EQUILOR FREGATT PRÉMIUM KÖTVÉNY BEFEKTETÉSI ALAP

Havi jelentés – 2019 február



Adatok zárása: 2019. február 28.

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

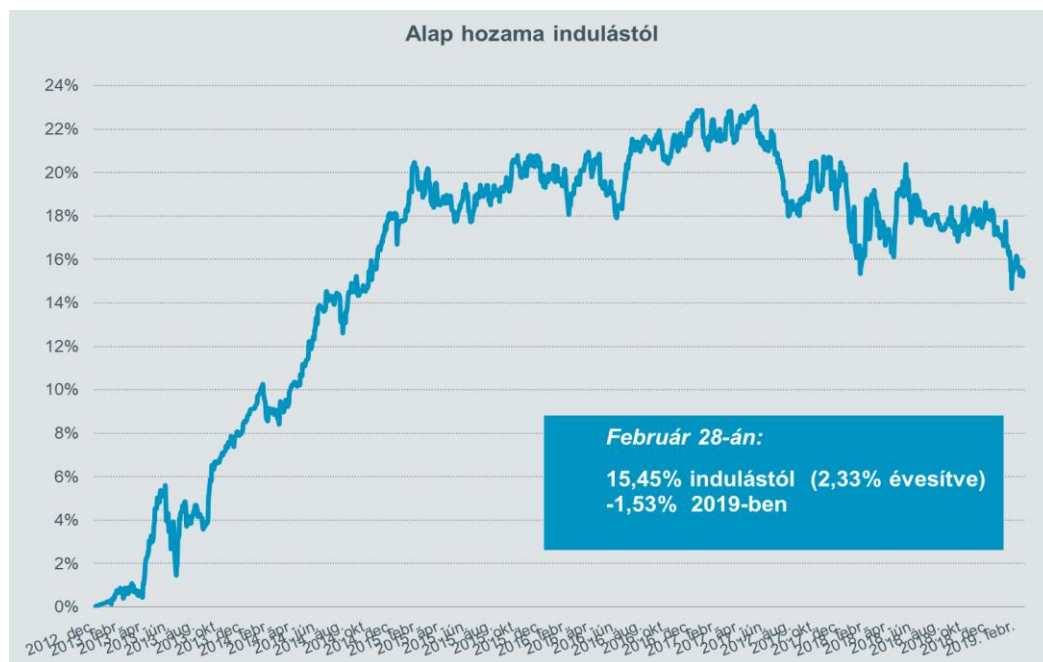
(2012.12.05)	Fregatt
napi hozamok:	
átlaga	0,009%
szórása	0,216%
évesítve	3,432%

hozamok:	
indulástól	15,45%
évesítve	2,33%
2019-ben	-1,53%

Évek	Hozam*
2012	0,17%
2013	8,96%
2014	7,92%
2015	1,77%
2016	2,48%
2017	-4,35%
2018	-0,22%

*Nettó hozamok

Az alap hozamának alakulása indulástól



10%-ot meghaladó, illetve az öt legnagyobb súlyú eszköz az alap eszköztéke százalékában

NÉV

US Treasury 03/2019, Bund 2X short ETF, 2020B, Proshares Ultrashort 20+Y TR, 2020A

Nettó összesített kockázati kitettség mértéke: 100,00%

Árfolyam, nettó eszközték és hozamok

1 jegyre jutó nettó eszközték:	1,155590 Ft
Eszközték:	58 500 876 Ft

Időszak	1 hónap	3 hónap	2019-ben	Indulástól*
Hozam	0,69%	-2,34%	-1,53%	2,33%
Benchmark	0,24%	1,01%	0,52%	5,68%

* 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 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.



Equilor Alapkezelő Zrt. • 1037 Budapest, Montevideo u. 2/C
Telefon: (36 1) 808 9250 • Fax: (36 1) 808 9251 • info@eqa.hu • www.eqa.hu

EQUILOR FREGATT PRÉMIUM KÖTVÉNY BEFEKTETÉSI ALAP

Havi jelentés – 2019 február



Piacok			Portfólió összetétele		
Részvénypiacok 2019-ben					
ország	index	hozam			
USA	S&P 500	11,08%			
USA	NASDAQ	9,11%			
USA	Russell 2000	16,83%			
Német	DAX	9,06%			
Brit	FTSE 100	5,15%			
Francia	CAC 40	10,78%			
Brazília	Bovespa	8,76%			
Kína	Shanghai	17,93%			
Japán	Nikkei 225	6,85%			
Lengyel	WIG 20	2,44%			
Cseh	PX index	8,63%			
Magyar	BUX	3,05%			
			Érték	Arány	
			Készpénz számlapénz	4 453 240 Ft	7,61%
			Állampapír	36 805 204 Ft	62,91%
			Kollektív befektetési értékpapírok	17 775 331 Ft	30,38%
			Kötelezettség	- 249 094 Ft	-0,43%
			Követelés	- Ft	0,00%
			Költségek	- 283 805 Ft	-0,49%
			Teljes nettó eszközérték	58 500 876 Ft	100,00%

Alapkezelői beszámoló

Az alap árfolyama februárban 0,69%-kal emelkedett. A teljesítmény elsősorban short kötvény ETF hó végi emelkedésének köszönhető. Ezt a forint további erősödése valamelyest visszafogta. A legutóbbi Fed kamatdöntő ülésről szóló jegyzőkönyvben a döntéshozók egyetértettek abban, hogy a jegybanki mérleg leépítése az idei évben megállhat, a munkaerőpiac tovább erősödött, a gazdasági aktivitás stabilan bővül. Az idei évben a GDP-növekedés üteme lassulhat, ezzel közelebb kerülhet a hosszabb távú becslésekhez. Ha valóban megállnak a dollárkamatok a jelenlegi szinteken, akkor az kedvezőtlenül hatna az alap árfolyamára.

Középtávon továbbra is bízunk a carry forintra gyakorolt nyomásában az amerikai dollárral szemben, amely a fedezetlen pozíciókon (Treasury Bill és ETF) keresztül pozitívan hathat az alap teljesítményére.

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.