

EQUILOR MAGNUS EUR SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP

Havi jelentés – 2016. szeptember

Adatok zárása: 2016. szeptember 30.

Általános információk

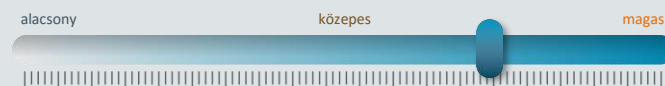
Típusa: nyilvános, nyíltvégű
Fajtája: abszolút hozamú alap
ISIN: HU0000714761
Deviza: EUR
Benchmark: EFFAS Eurobond Bond 1-3 Year Index (EUR-ban)
Letétkezelő: Raiffeisen Bank Zrt.
Alapkezelői díj: 2,0%
Elszámolási nap - vétel: T +2
Elszámolási nap - eladás: T +3
Alap indulása: 2015.06.17.

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 mindenkor piaci viszonyokhoz.

Minimálisan ajánlott befektetési időtáv: 5 év

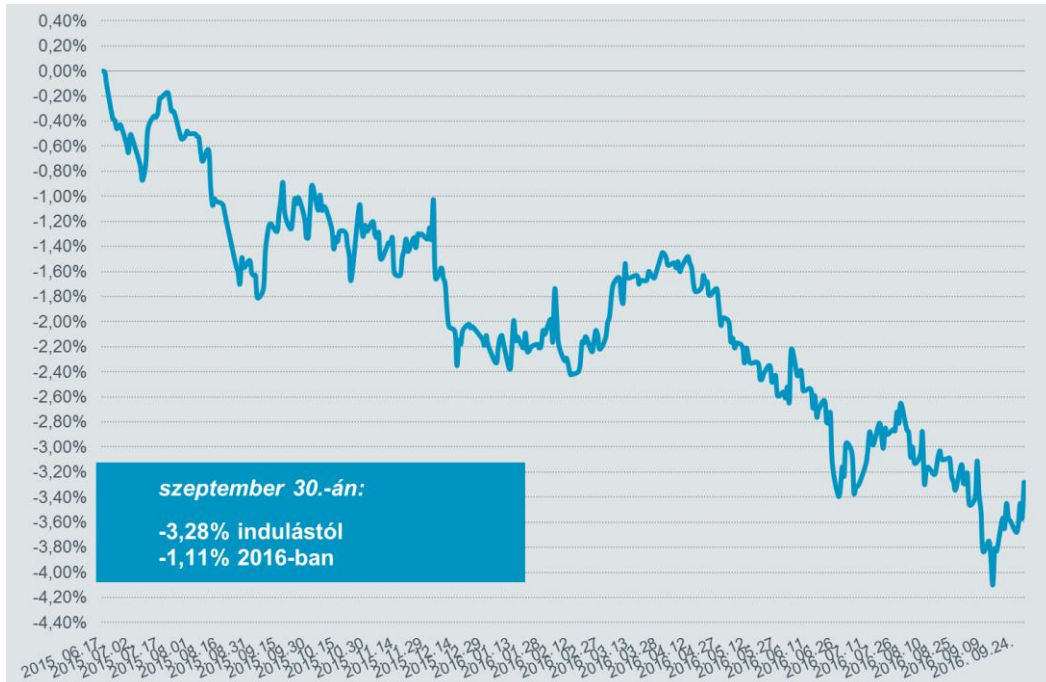
Kockázati besorolás



Statistika indulástól

(2015.06.17)	Magnus
napi hozamok:	
átlaga	-0,011%
szórása	0,138%
évesítve	2,194%
hozamok:	
indulástól	-3,28%
évesítve	-2,55%
2016-ban	-1,11%
egységnyi szórás (kockázat) hozama (évesített, indulástól)	
	-1,16%
kockázatmentes hozam (EONIA)	
	-0,31%
évesítve (indulástól)	
	-0,24%
többlethozam (évesítve, indulástól)	
	-2,31%
Sharpe mutató	
	-1,05%

Az Alap hozamának alakulása indulástól



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

Az első négy legnagyobb súlyú eszköz

Név	Kitettség
Pénzeszközök	29,65%
2018/A magyar államkötvény	19,79%
2017/A magyar államkötvény	6,37%
Intel	6,2%
Kockázati kitettség	100%

Árfolyam, nettó eszközérték és hozamok

1 jegyre jutó nettó eszközérték:	0,009671 EUR
Eszközérték:	653 154 EUR

Időszak	1 hónap	3 hónap	2016-ban	Indulástól
Hozam	0,01%	-0,05%	-1,11%	-3,28%
Benchmark	0,04%	-0,01%	0,34%	0,92%

Kereskedelmi kommunikáció - Jogi nyilatkozata

Jelen kereskedelmi kommunikáció nem tekinthető ajánlattételnek, illetve befektetési vagy adózási tanácsadásnak. Befektetési döntése meghozatala előtt, kérjük, mérlelje a befektetés tárgyát, kockázatát, díjait és a befektetésekből származó esetleges károkat. Továbbá döntése meghozatala előtt kérjük, hogy figyelmesen tanulmányozza át a Pénzügyi Szervezetek Állami Felügyelete által jóváhagyott Kiemelt Befektetői Információt (KIID), valamint az Alap hivatalos Tájékoztatóját és Kezelési Szabályzatát. Az Alaphoz kapcsolódó jóváhagyott Kiemelt Befektetői Információt 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 befektetési jegyeinek további forgalmazója az EQUILOR Befektetési Zrt. (Engedélyszám: ÁPTF 73.051/1998.) 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 forgalmazó (www.equilor.hu) 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

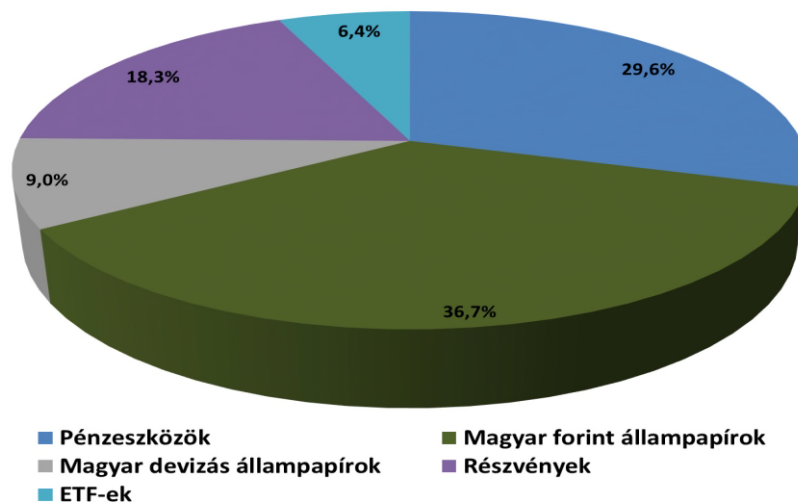
Havi jelentés – 2016. szeptember

Piacok

Részvénypiacok 2016-ban

ország	index	hozam
USA	S&P 500	6,08%
USA	S&P Midcap 400	-0,80%
USA	NASDAQ	1,89%
USA	Russell 2000	10,19%
EMU	EuroStoxx 50	-0,69%
Német	DAX	-2,16%
Brit	FTSE 100	10,53%
Francia	CAC 40	-4,07%
Brazília	Bovespa	34,64%
Kína	Shanghai	-15,10%
Japán	Nikkei 225	-13,58%
Lengyel	WIG 20	-8,05%
Cseh	PX index	-9,70%
Magyar	BUX	15,65%

Eszközök megoszlása



Alapkezelői beszámoló

Az alapban a hónap folyamán újabb termékek kerültek beillesztésre, illetve átsúlyozásra. A legfontosabb az alap szempontjából az Opusse, amit még a visszahívás megtagadása előtt értékesített az alap, ezzel kimaradva a meredek árfolyamesésből és realizálva a megszerzett profitot.

Nyersanyag kitettséget is beépítettünk a palládium és az olaj személyében. Ezek egyelőre még kis súllyal szerepelnek a portfolióban. A korábban említett Covestro részvények eladásra kerültek az esés utáni felfelé mozgásban.

Az alap ugyanakkor szerzett még kitettséget Kolumbiában egy index ETF-en keresztül. Ez a pozíció hosszabb távú, jó fundamentális körülmények és az árfolyam indokolta a belépőt.

Az alap a következő időszakokban alternatív stratégiai kitettséget fog fokozatosan felépíteni, szisztematikus volatilitás kereskedésén keresztül. Teszi ezt jellemzően majd az USA piacán. Ezzel a profitszerzésen kívül béta semlegességre is törekszik hosszú távon.

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, díjait és a befektetésekből származó esetleges károkat. Továbbá döntése meghozatala előtt kérjük, hogy figyelmesen tanulmányozza át a Pénzügyi Szervezetek Állami Felügyelete által jóváhagyott Kiemelt Befektetői Információt (KIID), valamint az Alap hivatalos Tájékoztatóját és Kezelési Szabályzatát. Az Alaphoz kapcsolódó jóváhagyott 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 befektetési jegyeinek további forgalmazója az EQUILOR Befektetési Zrt. (Engedélyszám: ÁPTF 73.051/1998.) 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 forgalmazó (www.equilor.hu) 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.