

# EQUILOR MAGNUS EUR SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP

Havi jelentés – 2017. február

Adatok zárása: 2017. február 28.

## 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

alacsony közepes magas

1 2 3 4 5 6 7

## Statistika indulástól

(2015.06.17)	Magnus
napi hozamok:	
átlaga	-0,007%
szórása	0,176%
évesítve	2,794%
hozamok:	
indulástól	-3,00%
évesítve	-1,77%
2017-ben	-0,96%
egységnyi szórás (kockázat) hozama (évesített, indulástól)	-0,63%
kockázatmentes hozam (EONIA)	-0,45%
évesítve (indulástól)	-0,27%
többlethozam (évesítve, indulástól)	-1,51%
Sharpe mutató	-0,54%

## 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 eszköztarték százalékában	
Név	Kitettség
Pénzeszközök	62,51%
2018/A magyar államkötvény	21,40%
2018/A magyar államkötvény	12,01%
<b>Nettó összesített kockázati kitettség mértéke</b>	<b>100,53%</b>

Árfolyam, nettó eszközérték és hozamok				
1 jegyre jutó nettó eszközérték:	0,009699 EUR			
Eszközérték:	586 359 EUR			
Időszak	1 hónap	3 hónap	2017-ben	Indulástól
Hozam	-0,42%	0,39%	-0,96%	-3,00%
Benchmark	0,16%	0,09%	-0,18%	0,78%

### 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](http://www.eqa.hu) honlapján, illetve a Felügyelet által üzemeltetett [www.kozzetetek.hu](http://www.kozzetetek.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](http://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](http://www.eqa.hu) és a Felügyelet által üzemeltetett [www.kozzetetek.hu](http://www.kozzetetek.hu) című honlapon elérhetőek.

# EQUILOR MAGNUS EUR SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP

Havi jelentés – 2017. február

Piacok		
Részvénytőzsdék 2017-ben		
ország	index	hozam
USA	S&P 500	5,57%
USA	S&P Midcap 400	2,50%
USA	NASDAQ	3,75%
USA	Russell 2000	2,18%
EMU	EuroStoxx 50	2,75%
Német	DAX	3,08%
Brit	FTSE 100	1,69%
Francia	CAC 40	-0,08%
Brazília	Bovespa	10,68%
Kína	Shanghai	4,45%
Japán	Nikkei 225	0,02%
Lengyel	WIG 20	12,49%
Cseh	PX index	3,51%
Magyar	BUX	0,18%

Portfólió összetétele		
	Érték	Arány
Készpénz számlapénz	366 542 €	62,51%
Állampapír	195 912 €	33,41%
Magyar és külföldi részvények	28 456 €	4,85%
Származtatott ügyletek eredménye	-2 187 €	-0,37%
Kötelezettség	-2 127 €	-0,36%
Költségek	-237 €	-0,04%
<b>Teljes nettó eszközérték</b>	<b>586 359 €</b>	<b>100,00%</b>

## Alapkezelői beszámoló

Február hónap a francia választás és az amerikai kamatemelési várakozások körül forgott. Egyre inkább az kezd a poll-ok alapján körvonalazódni, hogy nem Marine Le Pen lesz a befutó. Habár nem kell messzire menni az időben, ha a pollok eredményességét akarjuk nézni, elég ha Donald Trumpra vagy épp a brexit szavazásra gondolunk, ahol a pollok csúnyán kudarcot vallottak. Továbbra is azt látjuk, hogy az amerikai kamatemelés folytatódása és a francia választás fogja a leginkább mozgatni a piacokat és végül ez is fogja a piacok irányát megadni.

Az amerikai tőzsdén továbbra is nagyon jó a hangulat, amely az opciók árazásán is jól látszik. A VIX nagyon alacsony szinten van. Az alapban több új pozíció nyitását tervezzük, de jelenleg még várunk a kedvezőbb szintekre.

Február hónapban az alap nem létesített új pozíciókat, a meglévőekben történt átsúlyozás. REPHUN eurós állampapír eladása történt, felkészülve eurós termékek vételére.

## 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](http://www.eqa.hu) honlapján, illetve a Felügyelet által üzemeltetett [www.kozzetetelek.hu](http://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](http://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](http://www.eqa.hu) és a Felügyelet által üzemeltetett [www.kozzetetelek.hu](http://www.kozzetetelek.hu) című honlapon elérhetőek.