

EQUILOR MAGNUS EUR SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP

Havi jelentés – 2017. április

Adatok zárása: 2017. április 28.

Általános információk

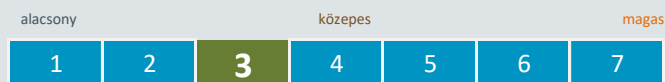
Típusa: nyilvános, nyíltvégű
Fajtája: abszolút hozamú alap
ISIN: HU0000714761
Deviza: EUR
Benchmark: EFFAS Eurobond Bond 1-3 Year Index (EUR-ban)
Letétkezelő: Raiffeisen Bank Zrt.
Alapkezelői díj: 2,0%
Elszámolási nap - vétel: T +2
Elszámolási nap - eladás: T +3
Alap indulása: 2015.06.17.

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



Statisztika indulástól

(2015.06.17)	Magnus
napi hozamok:	
átlaga	-0,005%
szórása	0,181%
évesítve	2,867%
hozamok:	
indulástól	-2,34%
évesítve	-1,26%
2017-ben	-0,29%
egységnyi szórás (kockázat) hozama (évesített, indulástól)	-0,44%
kockázatmentes hozam (EONIA)	-0,51%
évesítve (indulástól)	-0,27%
többlethozam (évesítve, indulástól)	-0,99%
Sharpe mutató	-0,34%

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 eszköztárában

Név	Kitettség
Pénzeszközök	56,61%
2018/A magyar államkötvény	21,06%
2018/A magyar államkötvény	11,79%
Nettó összesített kockázati kitettség mértéke	115,54%

Árfolyam, nettó eszközérték és hozamok

1 jegyre jutó nettó eszközérték:	0,009765 EUR			
Eszközérték:	590 346 EUR			
Időszak	1 hónap	3 hónap	2017-ben	Indulástól
Hozam	-0,27%	0,26%	-0,29%	-2,34%
Benchmark	0,02%	0,12%	-0,22%	0,74%

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 MAGNUS EUR SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP

Havi jelentés – 2017. április

Piacok

Részvénypiacok 2017-ben

ország	index	hozam
USA	S&P 500	6,49%
USA	S&P Midcap 400	0,76%
USA	NASDAQ	2,30%
USA	Russell 2000	3,19%
EMU	EuroStoxx 50	1,68%
Német	DAX	8,34%
Brit	FTSE 100	0,86%
Francia	CAC 40	8,33%
Brazília	Bovespa	8,59%
Kína	Shanghai	1,64%
Japán	Nikkei 225	0,43%
Lengyel	WIG 20	22,02%
Cseh	PX index	9,36%
Magyar	BUX	2,98%

Portfólió összetétele

	Érték	Arány
Készpénz számlapénz	331 842 €	56,21%
Állampapír	193 930 €	32,85%
Magyar és külföldi részvények	27 193 €	4,61%
Származtatott ügyletek eredménye	0 €	0,00%
Követelés	2 569 €	0,44%
Kötelezettség	-209 €	-0,04%
Költségek	-1 458 €	-0,25%
Kollektív befektetési értékpapírok	36 479 €	6,18%
Teljes nettó eszközérték	590 346 €	100,00%

Alapkezelői beszámoló

A még március hónapban nyitott SPY volatilitás pozíciókat lezártuk, ugyanis a volatilitás nem ugrott meg kellően, sőt április folyamán ismét csökkenésbe fordult. Számításba véve a javuló amerikai gazdasági adatokat, az amerikai piac emelkedése kiújulhat, ami viszont további volatilitás csökkenést/stagnálást vonhat maga után.

Új pozíciót létesítettünk az amerikai pénzügyi szektort követő ETF-ben, illetve a Covestroban is látunk további növekedési potenciált.

A francia választások első fordulóját Emmanuel Macron nyerte és a piacok el is kezdték árazni a végső győzelmét, mely euró erővel és a francia tőzsde emelkedésével párosult. A Wall Street Journal szerinti a globális politikai bizonytalanság új csúcson van, miközben a félelem index (VIX) a minimumok közelében, ami azt sejteti, hogy vagy a volatilitás ugrik meg, vagy pedig a politikai bizonytalanság enyhül. Véleményünk szerint, utóbbinak jelenleg nagyobb az esélye.

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.