

EQUILOR DINAMIKUS PORTFOLIÓ SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP

Havi jelentés – 2015. december

Adatok zárása: 2015. december 31.

Általános információk

Típusa: nyilvános, nyíltvégű
Fajtája: abszolút hozamú alap
ISIN: HU0000715289
Deviza: HUF
Benchmark: 100% ZMAX index
Letétkezelő: Raiffeisen Bank Zrt.
Alapkezelői díj: 2%
Vételi megbízás elszámolása: T+2
Eladási megbízás elszámolása: T+3
Alap indulása: 2015. december 20.

Befektetési politika

Az Alap kifejezetten magas kockázatot vállaló, magas hozam potenciált kereső befektetők igényeit kívánja kielégíteni. Az Alap céljának elérése érdekében az Alap minden befektetési eszközre - kötvény, részvény, nyersanyag, deviza, származtatott termékek - felvehet akár vételi, akár eladási pozíciót.

Ajánlott befektetési időtáv: 1 - 3 év

Kockázati besorolás

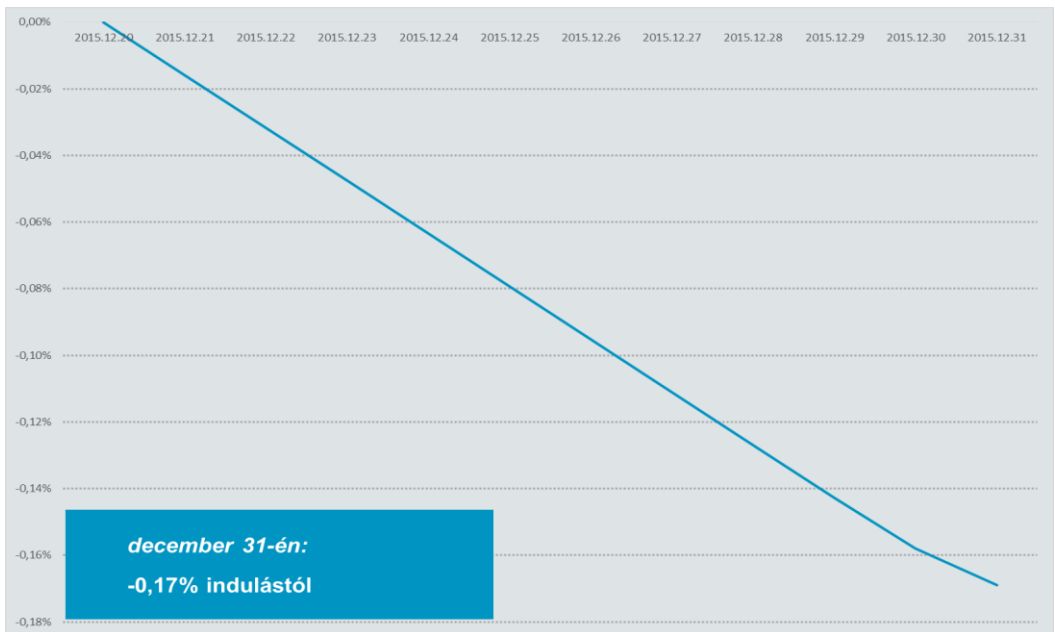
alacsony közepes magas



Statistika indulástól

(2015.11.27)	Dinamikus
napi hozamok:	
átlaga	-0,024%
szórása	0,023%
évesítve	0,359%
hozamok:	
indulástól	-0,17%
évesítve	N/A*
2015-ben	-0,17%
egységnyi szórás (kockázat) hozama (évesített, indulástól)	
	N/A*
kockázatmentes hozam (ZMAX) évesítve (indulástól)	
	0,04%
többlethozam (évesítve, indulástól)	
	N/A*
Sharpe mutató	
	N/A*

Az alap hozamának alakulása indulástól



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

A 3 legnagyobb súlyú eszköz

NÉV	Kitettség
Forint betét	100,00%
N/A	N/A
N/A	N/A
Kockázati kitettség	100,00%

Árfolyam, nettó eszközérték és hozamok

1 jegyre jutó nettó eszközérték:	0,998310 Ft			
Eszközérték:	318 960 119 Ft			
Időszak	1 hónap	3 hónap	2015-ben	Indulástól
Hozam	N/A	N/A	-0,17%	-0,17%
Benchmark	N/A	N/A	0,04%	0,04%

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.

EQUILOR DINAMIKUS PORTFÓLIÓ SZÁRMAZTATOTT BEFEKTETÉSI ALAP

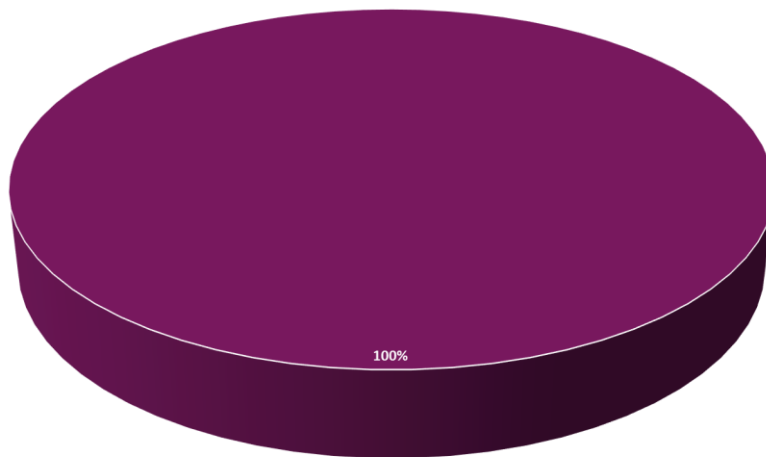
Havi jelentés – 2015. december

Piacok 2015-ben

Részvénypiacok

ország	index	hozam
USA	S&P 500	-0,73%
USA	S&P Midcap 400	-3,71%
USA	NASDAQ	5,73%
USA	Russell 2000	-5,71%
EMU	EuroStoxx 50	4,20%
Német	DAX	9,56%
Brit	FTSE 100	-4,65%
Francia	CAC 40	9,22%
Olasz	FTSE MIB	12,66%
Svájc	SMI	-1,84%
Japán	Nikkei 225	9,07%
Lengyel	WIG 20	-19,72%
Cseh	PX index	1,02%
Magyar	BUX	43,81%

Eszkömegoszlás kibocsátók szerint



■ Rövid lejáratú pénzeszközök

Alapkezelői beszámoló

Az Equilor Dinamikus Portfólió Származtatott Alap 2015 december 20-án kezdte meg működését. Az Alap célja, hogy kifejezetten magas kockázatot és így magas várható hozammal rendelkező befektetési ötleteket valósítson meg. Ennek megfelelően a tőke és pénzpiacok szinte minden szegmensében vehet fel vételi, vagy eladási pozíciót. Az Alap célja, hogy mindenkor benchmarkját meghaladva pozitív hozamot érjen el a befektetők számára. Az Alap benchmarkja 100%-ban a ZMAX index. Külön hangsúlyozni kell azonban az Alap kockázatos voltát, így a jövőben akár napi szinten is több százalékos elmozdulásra is számítani kell.

Az Alap, mivel éppen az ünnepek előtt kapta meg a működési engedélyt, nem vett fel pozíciót, a jegyzésből befolyt vagyont 100%-át rövid lejáratú, kockázatmentes bankbetétben kötötte le az év utolsó hetére. Az Alapot a jövőben magas kockázatú kereskedések fogják jellemezni, amely lehet akár daytrade, azaz napon belüli ügylet, vagy stratégiai, hosszabb távú pozíció is. Az Alap részvényeket, árupiaci termékeket, devizát és kötvényeket is tarthat a portfóliójában. Nem törekszünk a legdiverzifikáltabb portfólió összeállítására, hiszen akkor éppen a kockázatos voltát iktatnánk ki az Alap jellemzői közül, így az is elképzelhető, hogy a portfóliót mindössze néhány befektetési termék alkotja majd. A külföldi devizában denominált ügyletek attól függően lesznek fedezve, hogy az Alapkezelő mit vár az adott devizapár jövőbeli alakulásától.

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.