

## AXIOM APLUS SZÁRMAZTATOTT ALAP

### Az Alap adatai

|                    |  |                          |
|--------------------|--|--------------------------|
| Alapkezelő:        | <b>AXIOM Befektetési Alapkezelő Zrt.</b> | <b>Nettó eszközérték</b> |
| Letétkezelő:       | Raiffeisen Bank Zrt.                     | 591 158 392 HUF          |
| Vezető forgalmazó: | AXIOM Befektetési Alapkezelő Zrt.        |                          |
| ISIN kód:          | HU0000720552                             | <b>Árfolyam</b>          |
| Indulás:           | 2018.07.19                               | 1,006348 HUF             |
| Devizanem:         | HUF                                      |                          |

Az Alap nem használ referencia (benchmark) indexet, a teljesítményét a megállapított fix értékhez viszonyítva határozza meg.

Aktuális mértéke: 2,00%

### Befektetési stratégia

Az Alap célja, hogy a magyar állampapírok hozamát jelentősen meghaladó hozamot érjen el, - a lehetőségekhez képest - minél kisebb volatilitás és drawdown (max. visszaesés) mellett. Ennek érdekében az alapkezelő abszolút hozam stratégiát követ. Az Alap elsősorban kötvény, részvény és deviza piacokon vállal fel pozíciókat rövid és hosszabb lejáratokra egyaránt. A tőkeáttételes pozíciók akár kizárólagosan is szerepelhetnek az Alap portfóliójában, ezért az Alap kifejezetten kockázatos. A származtatott ügyletek miatt az egyes piacokon és devizákban a kitétség 100%-ot meghaladó mértékű lehet, a 78/2014. (III. 14.) Korm. rendelet 23. § (2) bekezdésének megfelelően az Alapnál alkalmazott tőkeáttétel maximális nagysága, a kezelési szabályzatban meghatározott harmincszoros lehet. Az Alap befektetési, pozíciói nem köthetők előre meghatározott piachoz, földrajzi vagy egyéb szektorhoz, meghatározott eszközosztályhoz.

Az Alap a befektetési döntések meghozatalakor alapvetően fundamentális tényezőkre, makrogazdasági elemzésekre támaszkodik, melyeket a technikai elemzés eszköztárával egészít ki. Az alapkezelők folyamatosan keresik a származtatott eszközökben időnként fennálló félrearázásokat, melyek a pozicionáltságnak megfelelően többelhozamot jelenthetnek.

### Forgalmazási információk

Az Axiom befektetési alapok forgalmazója az Axiom Befektetési Alapkezelő Zrt.  
Elszámolás: T+5 nap

### Havi aktualitások

Október hónap folyamán kettősség volt megfigyelhető. Míg a részvény piacokon és a feljett országok devizáiban jelentős mozgások voltak, addig a fejlődőpiaci devizák egészen kis sávban mozogtak vagy bizonyos esetekben (pl.:USD/TRY) komoly erősödés volt megfigyelhető. A hónap folyamán a devizaopciós pozíciók méretén nem változtattunk jelentős mértékben. Új elemként jelentek meg azonban az S&P500 indexre kötött opciók. Ebben az esetben arra számítunk, hogy az index otóberben látott csökkenése csak egy korrekció volt és rövid távon - év végéig - még inkább pozitív hangulat lesz a tőzsdéken. Így az emelkedés egy részéből mi is ki tudjuk venni a részünket anélkül, hogy egy esetleges további korrekció negatívan befolyásolná az alap teljesítményét. A devizapiaciakkal kapcsolatos véleményünk továbbra sem változott, nem számítunk sem jelentős erősödéssre, sem jelentős gyengülésre a forint piacán.

### Jogi nyilatkozat

Az alapok múltbeli teljesítménye nem nyújt garanciát a jövőbeli hozamok nagyságára. Jelen hirdetés nem minősül ajánlattételnek vagy befektetési tanácsadásnak. Az alap befektetési politikájáról és a befektetés lehetséges kockázatairól részletesen az Alap mindenkor forgalmazási helyein megtalálható kiemelt befektetői információjából, hivatalos tájékoztatójából és kezelési szabályzatából tájékozódhat. A befektetési alap forgalmazásával (vétel, tartás, eladás) kapcsolatos költségek az Alap kezelési szabályzatában és a forgalmazási helyeken megismerhetők.

| Eszköz részaránya NEÉ-hez képest     |                |
|--------------------------------------|----------------|
| Állampapírok                         | 0,00%          |
| Vállalati és hitelintézeti kötvények | 0,00%          |
| Részvények                           | 0,00%          |
| Kollektív értékpapírok               | 0,00%          |
| Számlapénz                           | 106,20%        |
| Derivatív pozíciók értéke            | -5,54%         |
| Követelés                            | 0,00%          |
| Kötelezettség                        | -0,66%         |
| <b>Összesen</b>                      | <b>100,00%</b> |
| Származtatott ügyletek               | 114,45%        |
| Deviza opciós pozíciók               | 114,45%        |
| Index pozíciók                       | 0,00%          |
| Futures pozíciók                     | 0,00%          |

| Deviza          | Részarány      |
|-----------------|----------------|
| HUF             | 52,92%         |
| EUR             | 0,00%          |
| NOK             | 0,00%          |
| PLN             | 0,00%          |
| SEK             | 47,07%         |
| USD             | 0,01%          |
| <b>Összesen</b> | <b>100,00%</b> |

**Összesített nettó kockázati kitétség**

**114,45%**

**10%-nál nagyobb kockázati kitétség**

long EURHUF forward pozíció

long EURSEK deviza opciós pozíció

long EURHUF deviza opciós pozíció

short EURHUF deviza opciós pozíció

**Az Alap teljesítménye és kockázati mutatók**

**Hozam adatok**

|                |       |
|----------------|-------|
| Elmúlt 1 hónap | 0,26% |
| Elmúlt 3 hónap | 0,76% |
| Elmúlt 6 hónap | n/a   |
| Elmúlt 1 év    | n/a   |

**Kockázati mutatók**

|                               |        |
|-------------------------------|--------|
| Sharpe-mutató                 | 0,00   |
| Sortino-mutató                | 0,00   |
| Legnagyobb visszaesés         | -5,39% |
| Pozitív hozamot elért hónapok | 2      |

|                               |       |
|-------------------------------|-------|
| Indulástól (évesített)**      | n/a   |
| Indulástól (nominális)        | 0,63% |
| Indulástól (FIX 2% nominális) | 0,57% |

|                                    |       |
|------------------------------------|-------|
| Napi hozamok szórása (évesített)** | n/a   |
| Napi hozamok szórása (nominális)   | 0,64% |

|                           |        |
|---------------------------|--------|
| Átlagos havi hozam        | 0,16%  |
| Legmagasabb havi hozam    | 4,48%  |
| Legalacsonyabb havi hozam | -3,99% |

**Az Alap kockázati besorolása**

|                              |                  |
|------------------------------|------------------|
| Az alap kockázata:           | 7 (nagyon magas) |
| Ajánlott befektetési időtáv: | 3-5 év           |

\*\* Az Alapban még nem telt el egy teljes üzleti év, így az évesített kockázati mutatók és az évesített hozam adatok nem relevánsak.

**AXIOM APLUS ÁRFOLYAM**

**1,006348 HUF**

**FIX 2%**

