

## AXIOM APLUS SZÁRMAZTATOTT ALAP

### Az Alap adatai

Alapkezelő:	<b>AXIOM Befektetési Alapkezelő Zrt.</b>	<b>Nettó eszközérték</b>
Letétkezelő:	Raiffeisen Bank Zrt.	589 607 131 HUF
Vezető forgalmazó:	AXIOM Befektetési Alapkezelő Zrt.	
ISIN kód:	HU0000720552	<b>Árfolyam</b>
Indulás:	2018.07.19	1,003707 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

Alapba megkötött pozíciók szempontjából kedvező árfolyammozgásokat hozott a szeptemberi hónap: mind a forint, mind a svéd korona jelentős erősödést tudott felmutatni a hónap folyamán, valamint a volatilitás is mérséklődött az opciós piacon, jelentősen javítva ezzel a pozíciók nyereségességét. A hónap eleje azonban még a relatíve gyenge forint jegyében telt, ezt kihasználva a forint dollárral szembeni erősödésére játszó hosszabb opciós pozíciót nyitottunk. Mivel a hónap végére a forint az euróval szemben nagyjából elérte az általunk korábban várt kereskedési sáv alját, - és további jelentős forint erősödésre rövid távon nem számítunk - hosszabb távú forint short pozíciót nyitottunk (euróellenében) az opciós piacon. Látna a forint erősödésének elakadását a hónap végén a put opciókiírásával megegyező irányú kisebb eur/huf vételi határidős pozíciót vettünk fel. Az Alap árfolyama szeptember hónapban jelentős mértékben emelkedett: az augusztus végi 95,9711-es árfolyamról szeptember 28-ra 100,3707-re nőtt. A hónap során külső befektetés nem növelte az alap nettó eszközértékét, mely az előző hóvégi 563.762.384 forintról szeptember 28-ra - így is több mint 25 millió forinttal - 589.607.131 forintra emelkedett.

### 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	106,56%
Derivatív pozíciók értéke	-5,97%
Követelés	0,00%
Kötelezettség	-0,59%
<b>Összesen</b>	<b>100,00%</b>
Származtatott ügyletek	101,65%
Deviza opciós pozíciók	101,65%
Index pozíciók	0,00%
Futures pozíciók	0,00%

Deviza	Részarány
HUF	49,73%
EUR	0,00%
NOK	0,00%
PLN	0,00%
SEK	50,27%
USD	0,00%
<b>Összesen</b>	<b>100,00%</b>

**Összesített nettó kockázati kitétség**

**101,65%**

**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	4,48%
Elmúlt 3 hónap	n/a
Elmúlt 6 hónap	n/a
Elmúlt 1 év	n/a

Indulástól (évesített)**	n/a
Indulástól (nominális)	0,37%
Indulástól (FIX 2% nominális)	0,39%

Átlagos havi hozam	0,12%
Legmagasabb havi hozam	4,48%
Legalacsonyabb havi hozam	-3,99%

**Kockázati mutatók**

Sharpe-mutató	0,00
Sortino-mutató	0,00
Legnagyobb visszaesés	-5,39%
Pozitív hozamot elért hónapok	1

Napi hozamok szórása (évesített)**	n/a
Napi hozamok szórása (nominális)	0,83%

**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**

**1,003707 HUF**

**FIX 2%**

