

AXIOM APLUS SZÁRMAZTATOTT ALAP

Az Alap adatai

Alapkezelő:	AXIOM Befektetési Alapkezelő Zrt.	Nettó eszközérték
Letétkezelő:	Raiffeisen Bank Zrt.	643 394 936 HUF
Vezető forgalmazó:	AXIOM Befektetési Alapkezelő Zrt.	
ISIN kód:	HU0000720552	Árfolyam
Indulás:	2018.07.19	0,995239 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 pozícionáltságnak megfelelően többelhozamot jelenthetnek.

Forgalmazási információk

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

Havi aktualitások

A decemberi jelentős pesszimizmus után az év első hónapjában 5,2%-ot emelkedett az 50 vezető európai vállalatot tömörítő részvényindex. A pozitív globális hangulat elsősorban a Fed elnök korrekciós nyilatkozatának volt köszönhető. Az Egyesült Államok és Kína között zajló kereskedelmi tárgyalásokról ugyan kedvezően vélekedett az amerikai kereskedelmi miniszter, óvatosságra adhat okot azonban, hogy bármilyen érdemi megegyezésre egyre kevesebb az idő márciusig. Az inflációs várakozások november óta jelentősen süllyedtek, a tízéves német állampapír hozam ismét alig haladja meg a 0%-os szintet. Nem változtatott az Európai Központi Bank a monetáris kondíciókon, Mario Draghi emelkedő inflációra számít középtávon, a gazdaságban továbbra is negatív kockázatok erősödését látja. Az euró-dollár kurzus a 1,1290- 1,1570 közötti sávban mozgott a hónap során. Az euró-forint árfolyam látható erősödése miatt a megszokottnál szélesebb sávban, 324,2-315 között ingadozott.

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	107,02%
Derivatív pozíciók értéke	-9,14%
Követelés	2,12%
Kötelezettség	0,00%
Összesen	100,00%
Származtatott ügyletek	385,30%
Deviza opciós pozíciók	321,05%
Index pozíciók	0,00%
Futures pozíciók	64,25%

Deviza	Részarány
HUF	70,48%
EUR	16,88%
NOK	2,32%
PLN	1,82%
SEK	1,35%
USD	7,15%
Összesen	100,00%

Összesített nettó kockázati kitétség

385,30%

10%-nál nagyobb kockázati kitétség

- long EURHUF forward pozíció
- short EURHUF deviza opciós pozíció
- short EUR alapú futures pozíció

Az Alap teljesítménye és kockázati mutatók

Hozam adatok

Elmúlt 1 hónap	-0,30%
Elmúlt 3 hónap	0,64%
Elmúlt 6 hónap	3,21%
Elmúlt 1 év	n/a

Kockázati mutatók

Sharpe-mutató	-0,02
Sortino-mutató	-0,02
Legnagyobb visszaesés	-5,39%
Pozitív hozamot elért hónapok	4

Indulástól (évesített)**	n/a
Indulástól (nominális)	-0,48%
Indulástól (FIX 2% nominális)	1,07%

Napi hozamok szórása (évesített)**	n/a
Napi hozamok szórása (nominális)	0,58%

Átlagos havi hozam	0,23%
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

0,995239 HUF

FIX 2%

