

AXIOM APLUS SZÁRMAZTATOTT ALAP

Az Alap adatai

Alapkezelő:	AXIOM Befektetési Alapkezelő Zrt.	Nettó eszközérték
Letétkezelő:	Raiffeisen Bank Zrt.	1 201 489 894 HUF
Vezető forgalmazó:	AXIOM Befektetési Alapkezelő Zrt.	
ISIN kód:	HU0000720552	Árfolyam
Indulás:	2018.07.19	0.369696 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 kitettség 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 többletőzapot jelenthetnek.

Forgalmazási információk

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

Havi aktualitások

2020 márciusában a COVID-19 vírus világméretű elterjedésére adott lépések hatására a gazdaság rekord méretű lassulása következett be. Ehhez jött hozzá, hogy az olajkitermelő országoknak (OPEC+) nem sikerült megegyezniük a termelés visszafogásáról, így egy kersleti sokk mellé egy kínálati sokk is társult. E két tényező együttes hatásának eredményeként a részvénypiacok soha nem látott gyorsasággal érték el a medve piacot jelentő -20%-os határt. Ezek a hatások a devizapiacokat is érzékenyen érintették, és az árfolyamemmozdulások mellett a volatilitás is jelentősen megugrott. A tőkeáttételes pozíciók miatt ezek a hatások az alap esetében felnagyítva jelentkeztek, így az alap árfolyama nagyon jelentős mértékben csökkent. A pozíciók nagy részét felszámoltuk, a jelenleg meglévő pozíciók PUT opciók melyek esetében nem kell tartani a lehívástól. Az események hatására az eddig folytatott stratégiánkat is felül kell vizsgálni. Ez folyamatban van. Mivel az alap deklaráltan kockázatos befektetéseket választott, a jelen helyzetben is úgy véljük, hogy a kockázatok átalakítása és nem azok jelentős visszafogása a megfelelő válasz a jelenleg kialakult helyzetre.

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 mindenkori 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	27.52%
Részvények	0.00%
Kollektív értékpapírok	0.00%
Számlapénz	81.62%
Derivatív pozíciók értéke	-9.13%
Követelés	0.00%
Kötelezettség	-0.01%
Összesen	100.00%
Származtatott ügyletek	114.32%
Deviza opciós pozíciók	114.29%
Index pozíciók	0.00%
Futures pozíciók	0.03%

Deviza	Részarány
HUF	78.02%
EUR	21.98%
NOK	0.00%
PLN	0.00%
SEK	0.00%
USD	0.00%
Összesen	100.00%

Összesített nettó kockázati kitettség

122.94%

10%-nál nagyobb kockázati kitettség

long USDHUF devizaopciós pozíció
short USDHUF devizaopciós pozíció

Az Alap teljesítménye és kockázati mutatók

Hozam adatok

Elmúlt 1 hónap	-63.19%
Elmúlt 3 hónap	-66.57%
Elmúlt 6 hónap	-63.47%
Elmúlt 1 év	-64.26%

Indulástól (évesített)	-44.28%
Indulástól (nominális)	-63.03%
Indulástól (FIX 2% nominális)	3.40%

Átlagos havi hozam	-3.08%
Legmagasabb havi hozam	5.10%
Legalacsonyabb havi hozam	-63.19%

Kockázati mutatók

Sharpe-mutató	-0.78
Sortino-mutató	-0.81
Legnagyobb visszaesés	-115.37%
Pozitív hozamot elért hónapok	11

Napi hozamok szórása (évesített)	59.33%
Napi hozamok szórása (nominális)	3.77%

Az Alap kockázati besorolása

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

AXIOM APLUS ÁRFOLYAM

0.369696 HUF

FIX 2%

