

AXIOM APLUS SZÁRMAZTATOTT ALAP

Az Alap adatai

Alapkezelő:	AXIOM Alapkezelő Zrt.	Nettó eszközérték
Letétkezelő:	Raiffeisen Bank Zrt.	1 418 557 807 HUF
Vezető forgalmazó:	AXIOM Alapkezelő Zrt.	
ISIN kód:	HU0000720552	Árfolyam
Indulás:	2018.07.19	0.417391 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 befektetései, 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 Alapkezelő Zrt.
Elszámolás: T+5 nap

Havi aktualitások

Augusztus hónap folyamán tovább folytatódott az MNB kamatemelési ciklusa, ezzel támogatva a forint arfolyamát a főbb devizákkal szemben valamint erősítette az MNB elköteleződését az inflációs célkövetést illetően. A tőzsdéken az ilyenkor szokásos módon alacsonyabb volt a forgalom, azonban ez sem akadályozta meg a legtöbb részvényindexet abban, hogy új történelmi csúcsot érjen el. Igaz ez annak ellenére, hogy az USA afganisztáni kivonulását követően hihetetlen sebességgel vették át a tálíbot az ország irányítását. Ez okozott némi feszültséget pénzpiacokon, azonban komolyabb hatást nem gyakorolt. A részvényeket ezeken a szinteken továbbra is igen drágának tartjuk. Korrekció alig volt az elmúlt időszakban. Egy jelentősebb 20%-os esés esetén vállalnánk kitettséget a vezető indexekben. A hónap folyamán lezárásra kerültek az EUR/SEK, EUR/NOK és EUR/HUF devizapároknak lévő pozícióink. Ősszel arra számítunk, hogy kis mértékben emelkedhet a volatilitás a deviza piacokon, így újabb pozíciókat tudunk felvenni.

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 (vétél, 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	3.66%
Számlapénz	97.99%
Derivatív pozíciók értéke	0.28%
Követelés	0.00%
Kötelezettség	-1.94%
Összesen	100.00%
Bruttó tőkeáttétel	134.81%
Deviza opciós pozíciók	0.00%
Index pozíciók	0.00%
Futures pozíciók	123.03%
Forward pozíciók	0.00%

Deviza	Részarány
HUF	-70.48%
EUR	26.38%
NOK	0.98%
JPY	0.00%
SEK	49.21%
USD	5.69%
Összesen (ABS)	152.74%

Összesített nettó kockázati kitettség

134.81%

10%-nál nagyobb kockázati kitettség

EURSEK deviza határidős pozíció

EURHUF deviza határidős pozíció

Az Alap teljesítménye és kockázati mutatók

Hozam adatok

Elmúlt 1 hónap	0.05%
Elmúlt 3 hónap	8.73%
Elmúlt 6 hónap	7.04%
Elmúlt 1 év	16.30%

Indulástól (évesített)	-24.42%
Indulástól (nominális)	-58.26%
Indulástól (FIX 2% nominális)	6.24%

Átlagos havi hozam	-1.31%
Legmagasabb havi hozam	6.66%
Legalacsonyabb havi hozam	-63.19%

Kockázati mutatók

Sharpe-mutató	-0.59
Sortino-mutató	-0.62
Legnagyobb visszaesés	-69.68%
Pozitív hozamot elért hónapok	22

Napi hozamok szórása (évesített)	44.69%
Napi hozamok szórása (nominális)	2.82%

Az Alap kockázati besorolása

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

AXIOM APLUS ÁRFOLYAM

0.417391 HUF

FIX 2%

