

AXIOM APLUS SZÁRMAZTATOTT ALAP

Az Alap adatai

Alapkezelő:	AXIOM Alapkezelő Zrt.	Nettó eszközérték
Letétkezelő:	Raiffeisen Bank Zrt.	1 417 905 431 HUF
Vezető forgalmazó:	AXIOM Alapkezelő Zrt.	
ISIN kód:	HU0000720552	Árfolyam
Indulás:	2018.07.19	0,417199 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 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 pozícionáltságnak megfelelően többelhozamot jelenthetnek.

Forgalmazási információk

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

Havi aktualitások

Július hónapban alapvetően pozitív hangulat uralkodott a pénzüpiacokon. Mind az olaj árfolyama mind pedig a tőzsde emelkedni tudott köszönhetően a gazdaság fellendülésébe vetett hitnek. A legnagyobb kockázat továbbra is az infláció alakulása, bár ez egyelőre nem aggasztja túlságosan a vezető jegybankok döntéshozóit. A delta variáns tersedése sem tudott érdemi hatást gyakorolni a piacokra. Az MNB tovább folytatta a kamatemelést, és további szigorítást helyezett kilátásba, bár ezek az intézkedések csak átmenetileg tudták erősíteni a forintot. Hosszabb távon arra számítunk, hogy a forint gyengülése lassul, az árfolyam stabilizálódhat az EUR-val szemben. Egy esetleges gazdasági turbulencia esetében azonban továbbra is megmarad a forint sérülékenysége. Az USA gazdasága továbbra is lépéselőnyben van az EU-val szemben, így rövid távon tovább erősödhet a dollár a többi devizával szemben. A hónap folyamán zártuk a nyitott pozícióinkat. Új pozíciót az EUR/NOK devizapárban és az EUR/SEK devizapárban nyitottunk. Mindkét esetben az EUR gyengülésére számítunk. Továbbá figyeljük, az EUR/HUF, EUR/USD, USD/HUF devizapárokat beszállási lehetőséget keresve.

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 mindenkorai 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.

Portfólió összetétele 2021.07.30

Eszköz részaránya NEÉ-hez képest	
Állampapírok	0,00%
Vállalati és hitelintézeti kötvények	0,00%
Részvények	0,00%
Kollektív értékpapírok	3,69%
Számlapénz	98,88%
Derivatív pozíciók értéke	0,01%
Követelés	0,00%
Kötelezettség	-2,57%
Összesen	100,00%
Bruttó tőkeáttétel	87,78%
Deviza opciós pozíciók	0,00%
Index pozíciók	0,00%
Futures pozíciók	50,53%
Forward pozíciók	25,27%

Devizakitettség

Deviza	Részarány
HUF	3,33%
EUR	-73,98%
NOK	26,25%
JPY	0,00%
SEK	50,53%
USD	5,85%
Összesen (ABS)	159,94%

Összesített nettó kockázati kitettség
87,78%
10%-nál nagyobb kockázati kitettség

EURSEK deviza határidős pozíció

EURNOK deviza határidős pozíció

Az Alap teljesítménye és kockázati mutatók
Hozam adatok

Elmúlt 1 hónap	3,23%
Elmúlt 3 hónap	6,71%
Elmúlt 6 hónap	9,21%
Elmúlt 1 év	22,70%

Indulástól (évesített)	-25,04%
Indulástól (nominális)	-58,28%
Indulástól (FIX 2% nominális)	6,07%

Átlagos havi hozam	-1,35%
Legmagasabb havi hozam	6,66%
Legalacsonyabb havi hozam	-63,19%

Kockázati mutatók

Sharpe-mutató	-0,60
Sortino-mutató	-0,63
Legnagyobb visszaesés	-69,68%
Pozitív hozamot elért hónapok	21

Napi hozamok szórása (évesített)	45,22%
Napi hozamok szórása (nominális)	2,86%

Az Alap kockázati besorolása

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

AXIOM APLUS ÁRFOLYAM
0,417199 HUF
FIX 2%
