

AXIOM APLUS SZÁRMAZTATOTT ALAP

Az Alap adatai

Alapkezelő:	AXIOM Alapkezelő Zrt.	Nettó eszközérték
Letétkezelő:	Raiffeisen Bank Zrt.	1 373 583 394 HUF
Vezető forgalmazó:	AXIOM Alapkezelő Zrt.	
ISIN kód:	HU0000720552	Árfolyam
Indulás:	2018.07.19	0,404157 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 többletőzapot jelenthetnek.

Forgalmazási információk

Az Axiom befektetési alapok forgalmazója az Axiom

Alapkezelő Zrt.

Elszámolás: T+5 nap

Havi aktualitások

Június hónap folyamán kitartott a befektetők körében az optimizmus, így a tőzsgék jól teljesítettek. A kockázatok között továbbra is a COVID járvány esetleges további hatásai valamint a megugró infláció jelenti a fő kockázatot. A meglévő pozícióink közül zártuk az EUR/USD short az USD/HUF long pozícióinkat, míg az EUR/HUF long kitettségenket csökkentettük. A forint árfolyamára az MNB kommunikációja és cselekedetei az átlagosnál nagyobb hatást gyakorolnak a közeljövőben. Összességében arra számítunk, hogy a forint árfolyam egy alacsonyabb sávban fog ingadozni az EUR-val szemben, azonban egy negatív sokk könnyen eltérítheti az árfolyamot a gyengülés irányába. Az EUR/USD devizapár esetében arra számítunk, hogy az USD tovább fog tudni erősödni. A norvég korona esetében továbbra is úgy véljük, hogy asszimmetrikusak a kockázatok. Az elmúlt időszakban az olajár emelkedését már nem követte a norvég korona erősödése, így egy esetleges olajár esés komoly EUR/NOK gyengülést vonhat maga után.

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	0,00%
Részvények	0,00%
Kollektív értékpapírok	3,98%
Számlapénz	96,57%
Derivatív pozíciók értéke	1,33%
Követelés	0,00%
Kötelezettség	-1,88%
Összesen	100,00%
Bruttó tőkeáttétel	217,03%
Deviza opciós pozíciók	0,00%
Index pozíciók	0,00%
Futures pozíciók	0,00%
Forward pozíciók	153,47%

Deviza	Részarány
HUF	-73,15%
EUR	206,46%
NOK	-75,70%
JPY	0,00%
SEK	0,00%
USD	5,96%
Összesen (ABS)	361,27%

Összesített nettó kockázati kitettség

217,03%

10%-nál nagyobb kockázati kitettség

EURHUF deviza határidős pozíció
EURNOK deviza határidős pozíció

Az Alap teljesítménye és kockázati mutatók

Hozam adatok

Elmúlt 1 hónap	5,28%
Elmúlt 3 hónap	4,48%
Elmúlt 6 hónap	7,41%
Elmúlt 1 év	7,54%

Indulástól (évesített)	-26,44%
Indulástól (nominális)	-59,58%
Indulástól (FIX 2% nominális)	5,90%

Átlagos havi hozam	-1,48%
Legmagasabb havi hozam	6,66%
Legalacsonyabb havi hozam	-63,19%

Kockázati mutatók

Sharpe-mutató	-0,62
Sortino-mutató	-0,65
Legnagyobb visszaesés	-69,68%
Pozitív hozamot elért hónapok	20

Napi hozamok szórása (évesített)	45,88%
Napi hozamok szórása (nominális)	2,90%

Az Alap kockázati besorolása

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

AXIOM APLUS ÁRFOLYAM

0,404157 HUF

FIX 2%

