

AXIOM APLUS SZÁRMAZTATOTT ALAP

Az Alap adatai

Alapkezelő:	AXIOM Alapkezelő Zrt.	Nettó eszközérték
Letétkezelő:	Raiffeisen Bank Zrt.	1 314 725 586 HUF
Vezető forgalmazó:	AXIOM Alapkezelő Zrt.	
ISIN kód:	HU0000720552	Árfolyam
Indulás:	2018.07.19	0,386839 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 pozicionáltságnak megfelelően többelhozamot jelenthetnek.

Forgalmazási információk

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

Havi aktualitások

Március hónapban a részvénypiacokon ismét a vevők kerültek túlsúlyba, így a vezető tőzszeindexek ismét új történelmi csúcsra tudtak emelkedni, ezzel együtt a részvények értékeltsége is korábban szinte soha nem látott magasságokban van. A devizapiacokon is érezhető volt a pozitív fordulat, így mind az EUR-val, mind pedig az USD-vel szembeni forint long pozícióink jól alakultak. Szintén jól alakult a SEK short pozícióink, a norvég korona short pozícióinkat pedig továbbra is tartjuk. Amennyiben a forint tovább erősödne úgy kitétséget vállalnánk fel az EUR-val szemben illetve figyelemmel kísérjük az EURUSD és EURPLN devizapárok alakulását. Ezekben a devizapárokból is tervezünk pozíciókat nyitni. Jelenleg nagyon pozitív a hangulat a befektetők körében, egyelőre úgy tűnik, hogy a hosszú távú hozamok emelkedése nem érezteti a hatását a részvénypiacokon. Továbbra is úgy gondoljuk, hogy ez az egyik legnagyobb kockázat, illetve a növekvő geopolitikai feszültség Ukrajna és Oroszország között. Amennyiben nyílt fegyveres konfliktussá fajulna a helyzet a két ország között az legalább átmenetileg mind a deviza mind pedig a részvény piacokon érezteti a hatását. A feltörekvő devizák ilyen esetekben érzékenyebben reagálnak az átlagonsál, így komolyabb gyengülés is elképzelhető lenne.

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 2021.03.31

Eszköz részaránya NEÉ-hez képest	
Állampapírok	0,00%
Vállalati és hitelintézeti kötvények	0,00%
Részvények	0,00%
Kollektív értékpapírok	4,31%
Számlapénz	97,72%
Derivatív pozíciók értéke	0,83%
Követelés	0,00%
Kötelezettség	-2,87%
Összesen	100,00%
Bruttó tőkeáttétel	339,94%
Deviza opciós pozíciók	0,00%
Index pozíciók	0,00%
Futures pozíciók	0,00%
Forward pozíciók	298,86%

Devizakitettség

Deviza	Részarány
HUF	164,92%
EUR	29,59%
NOK	-136,57%
JPY	0,00%
SEK	0,00%
USD	-16,86%
Összesen (ABS)	347,94%

Összesített nettó kockázati kitettség
268,66%
10%-nál nagyobb kockázati kitettség

EURHUF deviza határidős pozíció

EURNOK deviza határidős pozíció

Az Alap teljesítménye és kockázati mutatók
Hozam adatok

Elmúlt 1 hónap	-0,79%
Elmúlt 3 hónap	2,80%
Elmúlt 6 hónap	6,88%
Elmúlt 1 év	4,64%

Indulástól (évesített)	-29,64%
Indulástól (nominális)	-61,32%
Indulástól (FIX 2% nominális)	5,22%

Átlagos havi hozam	-1,76%
Legmagasabb havi hozam	6,66%
Legalacsonyabb havi hozam	-63,19%

Kockázati mutatók

Sharpe-mutató	-0,66
Sortino-mutató	-0,69
Legnagyobb visszaesés	-69,68%
Pozitív hozamot elért hónapok	18

Napi hozamok szórása (évesített)	47,72%
Napi hozamok szórása (nominális)	3,02%

Az Alap kockázati besorolása

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

AXIOM APLUS ÁRFOLYAM
0,386839 HUF
FIX 2%
