

AXIOM APLUS SZÁRMAZTATOTT ALAP

Az Alap adatai

Alapkezelő:	AXIOM Alapkezelő Zrt.	Nettó eszközérték
Letétkezelő:	Raiffeisen Bank Zrt.	1 388 059 485 HUF
Vezető forgalmazó:	AXIOM Alapkezelő Zrt.	
ISIN kód:	HU0000720552	Árfolyam
Indulás:	2018.07.19	0.408417 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

Október hónap folyamán a tőzsdék kisebb – nagyobb megingásokkal, de továbbra is emelkedtek. Ennek ellenére egyre több a bizonytalanság és a kockázati tényező a pénzpiacokon. Ezek közül a globálisan emelkedő infláció és az energia valamint a nyersanyag árak emelkedése jelenti a legnagyobb fenyegetést a gazdaságra. A nagy jegybankok előbb – utóbb kamatemelésre fognak kényszerülni mely a gazdasági növekedést fogja lassítani. A devizapiacokon a NOK erősödni tudott az EUR-val szemben elsősorban az olaj árfolyamának emelkedésének köszönhetően. A forint árfolyam a megugró inflációs számok miatt gyengült az EUR-val szemben, hiába kezdte meg a kamatemelési ciklusát az MNB. Ez a gyengülés, amennyiben nem változtat a jelenlegi politikán vélhetően folytatódni fog. A dollár erősödött az EUR-val szemben arra a várakozásra, hogy az FED előbb lép a monetáris szigorítás mezejére mint az EKB. Az alapban jelenleg a NOK és SEK short valamint HUF long pozíciókat tartunk az USD-vel és az EUR-ral szemben.

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	3.75%
Számlapénz	102.02%
Derivatív pozíciók értéke	-3.78%
Követelés	0.00%
Kötelezettség	-2.00%
Összesen	100.00%
Bruttó tőkeáttétel	290.93%
Deviza opciós pozíciók	0.00%
Index pozíciók	0.00%
Futures pozíciók	51.90%
Forward pozíciók	226.56%

Deviza	Részarány
HUF	100.23%
EUR	131.60%
NOK	-128.67%
JPY	0.00%
SEK	-51.90%
USD	-38.78%
Összesen (ABS)	451.18%

Összesített nettó kockázati kitettség

369.02%

10%-nál nagyobb kockázati kitettség

- EURSEK deviza határidős pozíció
- EURNOK deviza határidős pozíció
- USDHUF deviza határidős pozíció
- EURHUF deviza határidős pozíció

Az Alap teljesítménye és kockázati mutatók

Hozam adatok

Elmúlt 1 hónap	-4.08%
Elmúlt 3 hónap	-2.10%
Elmúlt 6 hónap	4.46%
Elmúlt 1 év	13.65%

Indulástól (évesített)	-23.88%
Indulástól (nominális)	-59.16%
Indulástól (FIX 2% nominális)	6.56%

Átlagos havi hozam	-1.29%
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	23

Napi hozamok szórása (évesített)	43.61%
Napi hozamok szórása (nominális)	2.75%

Az Alap kockázati besorolása

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

AXIOM APLUS ÁRFOLYAM

0.408417 HUF

FIX 2%

