

AXIOM APLUS ABSZOLÚT HOZAMÚ SZÁRMAZTATOTT ALAP

Az Alap adatai

Alapkezelő:	AXIOM Alapkezelő Zrt.
Letétkezelő:	Raiffeisen Bank Zrt.
Vezető forgalmazó:	AXIOM Alapkezelő Zrt.
ISIN kód:	HU0000720552
Indulás:	2018.07.19
Devizanem:	HUF

Nettó eszközérték
1,718,773,924 HUF

Árfolyam
0.561396 HUF

Az Alap referencia indexe: 30% SOLEUSOV Index + 5% IO9086EU Index + 40% SPFINO Index + 25%SPFISSE Index

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 nyolcszoros 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 félreértéseket, melyek a pozicionáltságnak megfelelően többelhozamot jelenthetnek.

Forgalmazási információk

Az Axiom befektetési alapok forgalmazói az Axiom Alapkezelő Zrt és a Raiffeisen Bank Zrt.
Elszámolás: T+5 nap

Havi aktualitások

Januárban az alacsonyabb hozamot biztosító euró pénzügyi befektetési alaphoz egy jelentős részét kicseréltük magasabb hozammal rendelkező hosszabb futamidejű euró kötvényekre. Továbbá az alap teljes euró kitettségének kb. 85%-át lefedeztük forint erősödésre játszva, amely a hónap folyamán jó döntésnek bizonyult. A francia pénzügyi szolgáltató cég és a dán dohánygyártó cég papírjait még mindig tartjuk.

A norvég korona a hónap során beerősödött az euróval szemben, így a nyitott pozíciónkból részlegesen zártunk, illetve a NOKSEK határidős pozíciókat továbbgörgettük, továbbra is bízva a svéd korona gyengülésében. Opció lehívás nem történt. Illetve újabb opció kiírás valósult meg a múlt hónapban.

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 mindenkor 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	34.08%
Vállalati és hitelintézeti kötvények	11.22%
Részvények	2.34%
Kollektív értékpapírok	9.48%
Számlapénz	51.23%
Betét	0.00%
Derivatív pozíciók értéke	1.61%
Követelés	0.00%
Kötelezettség	-9.96%
Összesen	100.00%
Bruttó tőkeáttétel	504.48%
Deviza opciós pozíciók	6.56%
Index pozíciók	0.00%
Futures pozíciók	0.00%
Forward pozíciók	380.09%

Deviza	Részarány
HUF	80.88%
EUR	53.27%
NOK	246.99%
GBP	1.83%
SEK	-280.26%
USD	0.84%
DKK	1.20%
Összesen (ABS)	665.27%
Összesített nettó kockázati kitettség	

413.99%

10%-nál nagyobb kockázati kitettség
NOKSEK deviza határidős pozíció
EURSEK deviza határidős pozíció

Az Alap teljesítménye és kockázati mutatók

Hozam adatok	
Elmúlt 1 hónap	4.52%
Elmúlt 3 hónap	-1.53%
Elmúlt 6 hónap	-4.81%
Elmúlt 1 év	-1.52%

Kockázati mutatók	
Sharpe-mutató	-0.38
Sortino-mutató	-0.49
Legnagyobb visszaesés	-69.68%
Pozitív hozamot elért hónapok	49

Indulástól (évesített)	-7.37%
Indulástól (nominális)	-43.86%
Indulástól (FIX 2% nominális)	15.08%

Napi hozamok szórása (évesített)	35.77%
Napi hozamok szórása (nominális)	1.87%

Átlagos havi hozam	-0.18%
Legmagasabb havi hozam	9.37%
Legalacsonyabb havi hozam	-63.19%

Az Alap kockázati besorolása	
Az alap kockázata:	7 (nagyon magas)
Ajánlott befektetési időtáv:	3 év

