

Fondsstrategie

De Alpha Global Index Trader maakt gebruik van geavanceerde computermodellen die speciaal voor het fonds zijn ontwikkeld. De volautomatische handelssystemen geven de aan- en verkoopmomenten aan. Geen emotie, maar vooraf gedefinieerde winstdoelen en speciaal op de markt afgestemd moneymanagement zorgen voor een hoge rendements-risico-ratio. Er wordt gehandeld in derivaten op meerdere indices, voornamelijk met een korte tijdshorizon. Het fonds wordt beheerd door Elite Fund Management, zij staat onder toezicht van de AFM en DNB.

Maandcommentaar

In december heeft het AGIT fonds een verlies geleden van 1,2 %. De markt was niet gunstig voor onze systemen, vooral omdat er weinig gebeurde.

De beleggers gingen rustig het jaar uit en ook Trump kwam deze keer niet weer met een verrassing door nog een keer extra of nog hogere tarieven in te stellen. Hierdoor ontstond weinig beweging, waardoor er geen flinke rally's plaatsvonden.

Het fonds heeft dit jaar wel positief afgesloten, maar het rendement was te laag. De belangrijkste oorzaak voor dit is het grillige marktpatroon met overall een hoge volatiliteit in begin 2025. Om risico's te vermijden moesten dikwijls verlies posities afgebroken worden. Terugkijkend was Buy en hold de beste strategie dit jaar. Daar staat tegenover dat potentiële hoge drawdowns en crashes dan voor lief genomen moeten worden wat juist het grootste risico is. De beperking van het risico kan gepaard gaan met minder rendement.

Fondsinformatie

ISIN code	NL0009210053	Fund Manager	Elite Fund Management
Beheer- en prestatievergoeding*	2% / 20%	Portefeuille beheerder	Frans Schreiber, (Jan Roozenburg)
In- of uitstapkosten	0.16%	Aantal participaties	748.7
Minimum investering	EUR 10000	Intrinsieke waarde per participatie	€ 82.25
Inschrijving	Maandelijks	Beheerd vermogen	€ 67,058

Rendementen Alpha Global Index Trader*														
Year	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	Year	Cumulatief
2007								+6.6	-0.9	-7.7	+13.0	-0.9	9%	9%
2008	+1.5	-1.5	+1.7	+6.1	-3.7	-8.6	+7.3	-3.1	+3.5	+8.4	+1.9	-5.8	6%	16%
2009	+5.8	+2.3	+13.8	+2.3	+3.2	-10.1	-0.7	-9.4	-2.4	+7.8	-4.0	-3.5	2%	19%
2010	+3.2	-0.8	-0.7	+1.8	+2.2	-2.2	+4.4	+1.6	+0.7	-3.8	+2.4	-1.2	8%	28%
2011	-0.7	+2.9	-2.9	-1.0	+1.6	+2.4	-1.9	+9.1	+3.6	+0.7	+1.4	+4.1	20%	54%
2012	-4.3	-1.2	-1.0	-2.1	-3.5	+2.9	+0.5	-0.0	+0.1	-2.1	+0.2	-1.4	-12%	36%
2013	-0.9	+0.9	+0.4	+2.6	-2.5	+0.2	-0.3	-2.7	-1.4	+2.6	+2.9	-1.8	0%	36%
2014	-1.4	+1.5	+1.4	-2.7	-0.5	+0.2	-0.2	-0.2	+2.2	+4.3	+0.0	+0.4	5%	42%
2015	+2.6	+1.9	+4.1	+0.5	-0.9	-0.2	+0.8	-5.6	+0.8	-0.0	+2.7	+1.1	8%	53%
2016	+1.1	+0.5	+0.3	-1.5	-3.9	-0.3	-0.2	-2.8	+5.7	-4.6	+0.5	-1.2	-7%	43%
2017	-3.7	-0.9	+2.3	-2.0	+1.3	+1.1	+0.1	-0.6	-0.4	-0.9	-0.2	-1.8	-6%	35%
2018	+2.0	-4.4	+2.8	-0.6	-0.8	-4.7	-1.0	-0.4	-2.3	-2.8	-1.5	-9.2	-21%	6%
2019	-0.1	-1.7	-1.5	-0.2	+0.9	-1.2	-0.5	-1.7	+1.1	+0.7	+1.6	-0.2	-3%	3%
2020	-2.9	+2.7	-29.4	-1.4	+9.0	+0.7	-4.1	+4.2	+2.2	-15.0	+7.3	-2.1	-30%	-28%
2021	+1.6	-0.5	-1.4	-0.9	-1.1	+0.4	-0.9	+0.0	-2.1	-4.2	-6.4	+1.6	-13%	-38%
2022	+3.3	-2.5	+3.1	-5.3	+7.7	+1.4	+1.1	-4.9	-10.6	+3.7	-0.4	-2.2	-3%	-39%
2023	-0.4	-0.4	-4.0	+0.4	+0.5	+1.1	+1.3	-1.0	-0.6	+0.7	+0.1	-1.1	-3%	-41%
2024	-2.1	-0.1	-0.5	+0.2	+0.6	-3.8	-12.0	+15.4	-5.0	-1.9	-3.0	-7.4	-18%	-18%
2025	+10.5	+0.7	-14.0	-2.1	+4.3	+1.7	+2.5	+0.7	-0.4	-2.6	+1.8	-1.2	0%	-18%

CS Managed Futures Index	
Year	Cum
3%	3%
19%	23%
8%	33%
12%	49%
-2%	46%
-3%	41%
-3%	38%
18%	63%
-1%	62%
-7%	50%
2%	52%
-8%	39%
6%	48%
0%	48%
8%	59%
18%	87%
-5%	78%
-9%	-10%
0%	-9%



Bronnen: Elite Fund Management, Morningstar. Rendementen sinds start/inceptie van het fonds gemeten van maandeinde tot maandeinde. Alpha Future Spread Fund is een subfonds van het Alpha High Performance Fund.

Disclaimer: Resultaten uit het verleden zijn geen garantie voor de toekomst. De informatie in deze publicatie is ontleend aan door Elite Fund Management BV betrouwbaar geachte bronnen. Elite Fund Management kan echter niet instaan voor de correctheid, betrouwbaarheid of juistheid van de weergegeven informatie en aanvaardt geen aansprakelijkheid voor willekeurig welk verlies veroorzaakt door het (direct of indirect) gebruik van deze publicatie of de inhoud van deze publicatie. Lees voordat u het fonds koopt de essentiële beleggers informatie (EBI) en het prospectus. Prestatievergoeding wordt op basis van een 'all-time high-water mark' berekend. Per mei 2024 is een nieuwe portefeuillemanager aangetrokken en worden nieuwe strategieën toegepast, daarom wordt het rendement vanaf dat moment opnieuw berekend en weergegeven.