

Fondsstrategie

De focus is vermogensbehoud, laag risico en geen correlatie met aandelen, obligaties en vastgoed. Dit Managed Futures-fonds heeft 15 handelsmodellen en handelt vooral in futures, aandelen en currencies. Vanaf mei 2009 is dit fonds live gehandeld door Frans Schreiber. Het resultaat is realtime, inclusief alle kosten. Het fonds heeft een lage correlatie met de AEX, aandelen, obligaties en vastgoed, maar ook met veel andere CTA-fondsen, terwijl het rendement en de Sharpe-ratio veel hoger zijn dan van andere CTA's. Het fonds wordt beheerd door Elite Fund Management, zij staat onder toezicht van de AFM en DNB.

Maandcommentaar

De straat van Straat van Hornuz is nu drie maanden gesloten, in deze periode is er nauwelijks olie of gas door deze trechter getransporteerd. Een deel van de terugval wordt opgevangen door andere producerende landen, de vraag is hoeveel het echte te kort is.

Want intussen stijgt de olieprijs niet verder, laten de markten zich niet kennen, de beurzen blijven stabiel en stijgen zelfs. Echter banken en economen voorspellen rampscenario's.

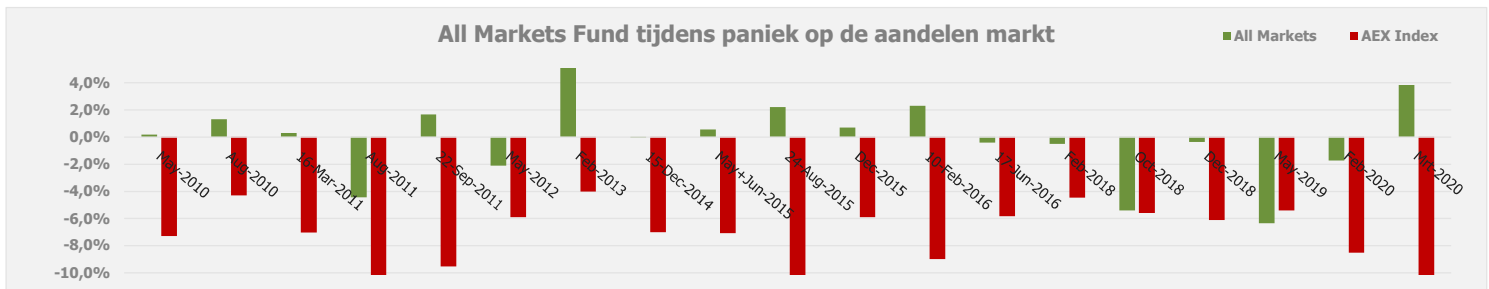
Intussen steeg ons fonds ook weer. Zowel de swingssystemen als de trendsystemen pakten deze maand geld. Bij de swingmodellen, verdienden alleen de long trades/ transacties geld. We kochten bijvoorbeeld Arista Networks (sector computer hardware) op 15 mei op \$137.46 en verkochten het met 10% winst op \$152 3 dagen later. De short handel had duidelijk meer moeite met de markt. Probleem is dat koersen vaak omhoog doorschieten, waardoor de shorttrades gemiddeld in de verliezen eindigen. De trendmodellen konden uptrend mooi opvolgen en maakten zo ook weer winst.

Fondsgegevens

ISIN code	NL0001641263	Fund Manager	Elite Fund Management
Beheer- en prestatievergoeding*	2.5% / 10%	Portefeuille beheerder	Frans Schreiber
In- of uitstapkosten	0,16%	Aantal participaties	114.655
Minimum investering	EUR 5000	Intrinsieke waarde per participatie	€ 51,07
Inschrijving	Maandelijks	Beheerd vermogen	€ 16.228.685

Rendementen All Markets Fund*														
Year	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	Year	Cumulatief
2009					+7,6	-1,5	-2,8	+0,8	+6,5	-4,5	+6,2	+1,2	14%	14%
2010	-5,6	+8,1	+4,6	+4,1	+0,2	-0,3	-3,4	+1,3	-1,5	+0,4	-1,7	+2,2	8%	23%
2011	+1,4	+2,7	+3,6	+3,3	-3,7	+0,7	-1,3	-4,4	+0,7	-0,2	-2,1	-0,2	0%	23%
2012	+0,1	-0,9	+0,2	+0,8	-2,1	-1,7	-3,4	-2,0	+2,0	-3,1	+2,5	+1,8	-6%	15%
2013	-0,9	+5,2	+2,4	+3,3	-2,6	+0,4	-1,2	-4,0	-2,2	+5,7	+2,7	-0,1	9%	25%
2014	+1,9	-0,2	-0,7	+8,7	+2,8	+1,6	-2,8	-0,6	-3,3	-8,9	+3,9	-0,5	1%	26%
2015	-1,5	+2,1	+5,4	-0,7	+4,6	+0,2	+1,3	+0,4	+0,4	+2,3	-0,2	+0,7	16%	46%
2016	-10,8	+11,2	-0,2	-1,9	-0,3	+0,8	-1,3	-7,6	+10,6	-0,9	+5,6	+4,9	8%	58%
2017	+0,6	+1,9	-0,9	+0,8	+4,9	+2,2	-1,1	+3,5	+2,8	+3,7	-1,7	+2,4	21%	90%
2018	+0,7	-0,5	+1,9	-0,7	-0,1	-2,0	+1,1	+2,7	+3,4	-5,4	+0,7	-0,3	1%	93%
2019	-3,2	-0,3	+1,4	-2,2	-6,4	-1,2	+0,2	-2,8	-1,0	-0,3	+4,4	+0,1	-11%	71%
2020	-6,5	-1,7	+3,8	-1,2	+2,4	-1,1	-0,1	+2,1	-3,0	-3,8	+2,2	+4,4	-3%	66%
2021	+0,4	+6,3	+0,3	+0,7	+2,9	+1,5	-2,5	+3,9	-3,4	+4,7	-1,0	+1,2	16%	92%
2022	-6,3	+4,0	-0,9	+2,8	+0,4	-0,2	-1,3	-4,1	+1,2	+0,9	+2,2	-2,2	-4%	84%
2023	-1,7	-1,2	-0,8	+3,2	+0,8	+7,0	+4,2	-0,8	-5,1	-3,8	+5,3	+8,1	15%	113%
2024	+0,1	+4,7	+3,2	-8,5	+5,0	+2,6	-0,5	+6,2	-1,5	+0,0	+2,0	-3,9	9%	131%
2025	+3,7	+1,4	-10,6	+1,2	+1,4	+1,9	-1,2	-0,2	-1,9	+3,0	-5,9	+4,0	-4%	122%
2026	-1,1	+2,0	-3,2	-7,2	+1,9								-8%	105%

Benchmark: CS Managed Futures Index	
Year	Cum
-1%	-1%
12%	12%
-2%	9%
-3%	6%
-3%	3%
18%	22%
-1%	21%
-7%	12%
2%	14%
-8%	4%
6%	11%
0%	11%
8%	19%
18%	40%
-5%	33%
1%	35%
1%	35%
10%	49%



Bronnen: Elite Fund Management, Morningstar. Rendementen sinds inceptie van het fonds gemeten van maandeinde tot maandeinde. Rendementen tijdens paniek momenten gebaseerd op een selectie van maanden/dagen of periode van andere lengten waarin er specifieke paniekachtige/crisisachtige situaties voordeden. Prestatievergoeding wordt berekend op basis van een 3-jaars high-water mark. Het All Markets 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 accepteert geen verantwoordelijkheid 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. *NB: het fonds kan leverage gebruiken en hedging toepassen, de AEX Index niet, dus de vergelijking is niet helemaal perfect.