

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 financiële markten bleven in augustus beweeglijk, waarbij geopolitieke spanningen en onzekerheid over rente en inflatie het beeld bepaalden. De situatie rond de Straat van Hormuz zorgde opnieuw voor sterke bewegingen in de olie- en energiemarkten. Tegelijkertijd liepen de lange rentes op door zorgen over inflatie, begrotingstekorten en oplopende overheidsschulden.

Aandelenmarkten hielden zich relatief goed, mede dankzij sterke bedrijfsresultaten en aanhoudende investeringen in kunstmatige intelligentie. Onderliggend waren er echter forse bewegingen en wisselingen tussen sectoren, rente, valuta en grondstoffen.

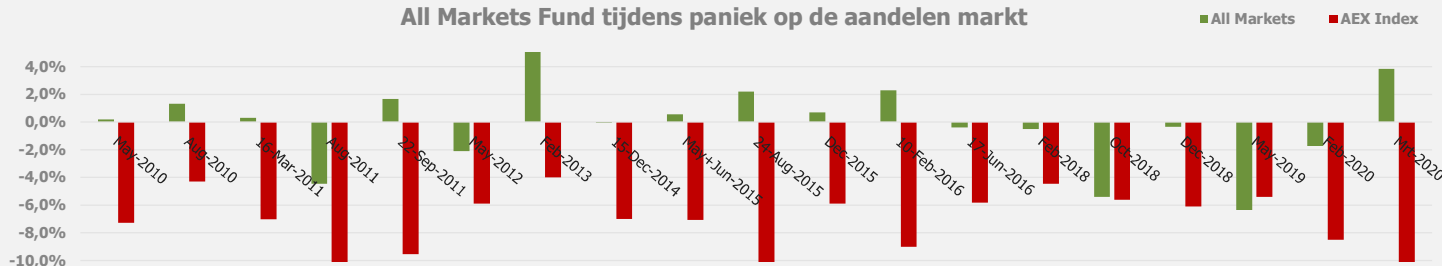
Deze regelmatig wisselende marktrichtingen waren deze keer minder gunstig voor de verschillende systematische strategieën binnen het All Markets Fund. De swingsystemen konden er per saldo geen winst uithalen en sloot het fonds augustus met een negatief rendement af van -1.6 procent.

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	114.385
Minimum investering	EUR 5000	Intrinsieke waarde per participatie	€ 53,22
Inschrijving	Maandelijks	Beheerd vermogen	€ 13.297.929

Rendementen All Markets Fund*															Benchmark: CS Managed Futures Index	
Year	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	Year	Cumulatief	Year	Cum
2009					+7,6	-1,5	-2,8	+0,8	+6,5	-4,5	+6,2	+1,2	14%	14%	-1%	-1%
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%	12%	12%
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%	-2%	9%
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%	-3%	6%
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%	-3%	3%
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%	18%	22%
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%	-1%	21%
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%	-7%	12%
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%	2%	14%
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%	-8%	4%
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%	6%	11%
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%	0%	11%
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%	8%	19%
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%	18%	40%
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%	-5%	33%
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%	1%	35%
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%	1%	35%
2026	-1,1	+2,0	-3,2	-7,2	+1,9	-0,6	+6,5	-1,6					-4%	114%	14%	54%

All Markets Fund tijdens paniek op de aandelen markt



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 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. *NB: het fonds kan leverage gebruiken en hedging toepassen, de AEX Index niet, dus de vergelijking is niet helemaal perfect.