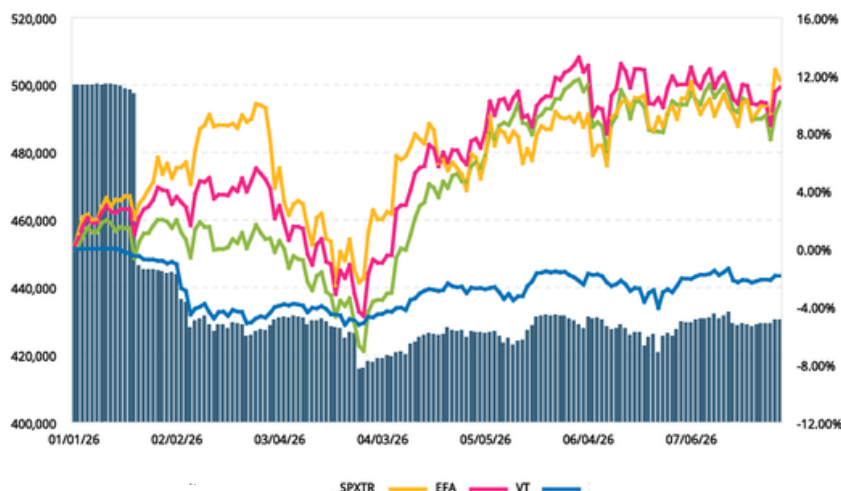


Financiële Toekomst Absolute Quant Fund - DE MAAND JULI

In juli volgde het FT Absolute Quant Fund de systematische risicogestuurde aanpak waarop het is gebaseerd. De markten lieten gedurende de maand wisselende koersontwikkelingen zien, waarop het model een sterk defensieve positionering handhaafde. Daardoor bestond circa 94% van de portefeuille uit cash en bleef de blootstelling aan aandelen beperkt. Deze defensieve positie leidde tot een waardeinstijging van +1,16%, waarbij positieve bijdragen onder meer afkomstig waren van META, INTU, REGN, CEG en MAR. Daartegenover stonden negatieve bijdragen van onder andere NFLX, ORCL, C, SNPS en CPRT. Door de hoge cashpositie bleef de volatiliteit van het fonds gedurende de maand laag en bleef de maximale drawdown beperkt tot 0,98%. De strategie anticipeert niet op verwachtingen, maar reageert uitsluitend op feitelijke prijsbewegingen. Wanneer markten een nieuwe richting ontwikkelen en trends zich vormen, kan het model opnieuw signalen genereren. Juli kenmerkte zich daarmee door een zeer defensieve positionering met een hoge cashpositie, beperkte blootstelling aan aandelen en een positief rendement.

Net Asset Value

Cumulative Return



De grafiek vergelijkt de performance van het fonds met:

- SPXTR – S&P 500 Total Return Index
- EFA – MSCI EAFE Index
- VT – Vanguard Total World Index ETF

Waarom deze beurzen in de wereld?

Deze indices vertegenwoordigen respectievelijk de Amerikaanse markt, ontwikkelde internationale markten en wereldwijde aandelenmarkten. Samen vormen zij een brede en evenwichtige vergelijking.

Periode:

1 januari 2026 – 31 juli 2026

Bron: PortfolioAnalyst (Clearing Broker) – marktdata via Thomson Reuters en externe prijsleveranciers.

Toelichting grafiek

- Startdatum: 1 januari 2026
- Einddatum: 31 juli 2026
- Vergelijkingsbasis: de getoonde wereldwijde beursindices zijn genormaliseerd en starten op dezelfde beginwaarde, zodat verschillen in ontwikkeling zichtbaar worden. Deze vergelijking is uitsluitend illustratief en vormt geen benchmark.
- NAV-lijn: toont de ontwikkeling van het fonds vanaf het begin van 2026. Per eind juli behaalde het fonds een YTD-rendement van -1,87%, tegenover +10,14% voor SPXTR, +11,67% voor EFA en +11,15% voor VT.
- Vergelijkingslijnen (wereldwijde beurzen): tonen de geïndexeerde rendementen van SPXTR, EFA en VT over dezelfde periode.

Kostenstructuur van het fonds (Participatieklasse A)

- **Beheervergoeding:** 1,75% per jaar (min. €1.500 per maand, op fondsniveau)
- **Performance fee:** geen (alleen Klasse B: 10% high watermark)
- **Bewaarder (variabel):** 0,02% per jaar over de NAV
- **Participantenadministratie (variabel):** 0,05% over in- en uitstapwaarde
- **Financiële administratie (variabel):** 0,06% over €1–10M, 0,04% over €10–25M, 0,02% boven €25M
- **Transactiekosten:** variabel (brokerkosten en spreads, verwerkt in halfjaarverslag)
- **Indexatie:** jaarlijkse aanpassing o.b.v. het CBS-CPI

Bij een startinleg van €1.000 en €100 per maand bedragen de kosten voor de belegger ongeveer €38 per jaar, afhankelijk van het totale fondsvermogen en de vaste fonds kosten.

NAV: 98.2919

31 juli 2026

RENDEMENT

Rendement maand juli: +1,16%

RISICO

Volatiliteit 0.26%
Maximum drawdown 0.98%
risico indicator: 6/7

EFFICIËNTIE

Sharpe ratio (juli 2026, niet-annualized, RF = US 3M T-Bill): 2.25
Sortino ratio (juli 2026, niet-annualized, RF = US 3M T-Bill): 3.04

Fond informatie

Fondsnaam: FT (Financiële Toekomst) Absolute Quant Fund

Beheerder (AIFM): Elite Fund Management B.V.

ISIN: NL0015002N49

Fondsstructuur: Subfonds van Alpha High Performance Fund (AIF)

Type product: Alternatieve beleggingsinstelling (ABI), systematisch kwantitatief fonds

Beleggingsstrategie: Long-only trendomkeringsmodel op zeer liquide aandelen (S&P100 / Nasdaq100)

Aanbevolen beleggingshorizon:

Minimaal 5 jaar

Valuta: EUR

Doel van het fonds

Het fonds streeft naar een gemiddeld jaarrendement van 8% op een vijfjaars-beleggingshorizon; daarom wordt tevens een meerjarige (5-jaars) periode in de factsheet opgenomen.



De informatie in deze publicatie is ontleend aan door Elite Fund Management B.V. betrouwbaar geachte bronnen. Elite Fund Management kan echter niet instaan voor de correctheid, volledigheid of juistheid van de weergegeven informatie en aanvaardt geen verantwoordelijkheid voor enig verlies dat direct of indirect voortvloeit uit het gebruik van deze publicatie of de inhoud daarvan. Eventuele vergelijkingen met indices dienen uitsluitend ter indicatie; het fonds kan gebruikmaken van leverage en hedging-strategieën, terwijl deze niet worden toegepast door de gebruikte indices, waardoor de vergelijking niet één-op-één is.

In het verleden behaalde resultaten bieden geen garantie voor de toekomst. Beleggen in dit fonds brengt risico's met zich mee; u kunt (een deel van) uw inleg verliezen. Deze publicatie vormt geen aanbod of uitnodiging tot deelname en is uitsluitend bedoeld ter informatie.

Lees vóór een investering het prospectus en het Essentiële informatiedocument (EID). Deze documenten zijn kosteloos verkrijgbaar bij de beheerder, Elite Fund Management B.V. en te vinden op website van de Beheerder, www.EliteFundManagement.com