

Toelichting van de strategie

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. De beheerder staat onder toezicht van de AFM en DNB.

Maandcommentaar van de investment advisor

De beurzen hebben zich in juni vooral omhoog bewogen, onderbroken door een terugval halverwege de maand. Die terugval ging voer ons volgens berekende patronen: met trades die ieder slechts 1 tot enkele dagen duurden werd een positief rendement gerealiseerd. Daarnaast was de tussentijdse drawdown verwaarloosbaar. De optiehandel had deze maand weer winst, de future dagtrades op voor al de S&P500 en de olie maakten verlies. De volatiliteit op de beurzen neemt verder af, maar is historisch gezien nog steeds bijna tweemaal zo hoog als het gemiddelde. Dat is goed voor de modellen in Alpha Global Index Trader.

Fondsinformatie

❖ ISIN code:	NL0009210053	❖ Inschrijvingen:	maandelijks
❖ Beheers- en prestatievergoeding*	2%/20%	❖ Investment advisor	Aat Schornagel/Peter Zwag
❖ In- of uitstapkosten:	0,16%	❖ Aantal participaties:	716,8969
❖ Minimum investering:	EUR 10.000	❖ Intrinsieke waarde per participatie	EUR 790,3420
		❖ Beheerd vermogen:	EUR 566.593,73

Alpha Global Index Trader*

Year	Jan	Feb	Mrt	Apr	Mei	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dec	YTD	Cum
2007	-	-	-	-	-	-	-	+6,6%	-0,9%	-7,7%	+13,0%	-0,9%	+9,1%	+9,1%
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%	+6,3%	+15,9%
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%	+2,4%	+18,8%
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%	+7,5%	+27,7%
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%	+20,3%	+53,6%
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%	-11,5%	+35,9%
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%	-0,2%	+35,6%
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%	+4,9%	+42,2%
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%	+7,7%	+53,1%
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%	-6,6%	+43,1%
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%	-5,8%	+34,8%
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%	-21,2%	+6,2%
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%	+0,7%	+7,0%
2020	-2,9%	+2,7%	-29,4%	-1,4%	+9,0%	+0,7%	-	-	-	-	-	-	-23,8%	-18,4%

AEX Index*

Year	Jan	Feb	Mrt	Apr	Mei	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dec	YTD	Cum
2007	-	-	-	-	-	-	-	-2,1%	+3,5%	+1,3%	-7,4%	+1,6%	-3,4%	-3,4%
2008	-14,4%	+1,2%	-0,9%	+7,5%	+2,1%	-12,3%	-6,1%	+3,2%	-19,7%	-19,2%	-5,7%	-2,6%	-52,3%	-53,9%
2009	+1,1%	-11,6%	-1,3%	+11,0%	+7,8%	-1,8%	+11,2%	+4,6%	+5,1%	-2,9%	+1,2%	+9,6%	+36,3%	-37,2%
2010	-2,2%	-3,1%	+8,3%	+0,5%	-7,3%	-1,2%	+4,4%	-4,3%	+5,7%	+0,8%	-2,9%	+8,3%	+5,7%	-33,6%
2011	+1,7%	+2,3%	-1,0%	-1,6%	-2,9%	-2,8%	-3,1%	-11,0%	-4,4%	+9,8%	-2,5%	+4,3%	-11,9%	-41,5%
2012	+1,9%	+1,8%	-0,2%	-4,7%	-5,9%	+5,9%	+6,2%	+0,9%	-1,9%	+2,3%	+1,8%	+1,8%	+9,7%	-35,8%
2013	+3,4%	-3,9%	+2,2%	+0,9%	+3,4%	-5,2%	+7,3%	-1,9%	+3,3%	+4,5%	+1,2%	+1,3%	+17,2%	-24,8%
2014	-3,7%	+3,0%	+1,2%	-0,7%	+1,7%	+1,5%	-2,1%	+2,2%	+1,9%	-2,3%	+3,5%	-0,3%	+5,6%	-20,5%
2015	+6,1%	+7,4%	+1,1%	-0,3%	+1,2%	-4,3%	+4,8%	-10,1%	-5,4%	+9,7%	+1,6%	-5,9%	+4,1%	-17,3%
2016	-2,4%	-0,9%	+3,0%	-0,1%	+1,9%	-2,7%	+3,2%	+1,0%	-0,5%	+0,1%	+1,0%	+5,7%	+9,4%	-9,5%
2017	-1,3%	+3,9%	+4,3%	+0,9%	+0,6%	-3,2%	+3,6%	-1,8%	+4,1%	+3,0%	-2,4%	+0,8%	+12,7%	+2,0%
2018	+2,9%	-4,4%	-1,1%	+4,9%	-0,5%	-0,2%	+4,1%	-2,8%	-1,6%	-5,6%	+0,1%	-6,1%	-10,4%	-8,6%
2019**	+6,7%	+3,9%	+1,5%	+4,1%	-5,4%	+3,9%	+1,8%	-2,4%	+3,9%	-0,6%	+3,6%	+1,2%	+5,8%	-3,4%
2020	-2,5%	-8,5%	-10,4%	+6,1%	+3,8%	+5,1%	-	-	-	-	-	-	-7,4%	-10,5%

* Bronnen: Elite Fund Management, Morningstar. Rendementen sinds start/inceptie van het fonds gemeten van maandende tot maandende.

** Vanaf mei 2019 is het beleid aangepast en wordt het portfolio management grotendeels uitgevoerd door Aat Schornagel.

Disclaimer

Resultaten uit het verleden zijn geen garantie voor de toekomst. De informatie in deze publicatie is ontleend aan door EliteFund 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 'alltime high-water mark' berekend.

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