

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 portefeuille manager

In augustus eindigden de beurzen dicht op het punt waar ze begonnen. Maar tussentijds ging het flink op en neer, ideaal voor de optie systemen die met alle opwaartse en neerwaartse bewegingen meededen en ruim 4% winst genereerden. De handelssystemen zien dus flinke volatiliteit volgens vertrouwde patronen. En met Amerikaanse verkiezingen in het vooruitzicht en voortdurende Corona onzekerheid zullen de beurzen nog wel een tijdje volatiel blijven en de handelsmodellen volop kansen bieden om nog meer winsten te behalen.

Fondsinformatie

❖ ISIN code:	NL0009210053	Fund Manager:	Elite Fund Management
❖ Beheers- en prestatievergoeding*	2%/20%	Portefeuille manager:	Frans Schreiber (Aat Schornagel/PZwag)
❖ In- of uitstapkosten:	0,16%	Aantal participaties:	714,1127
❖ Minimum investering:	EUR 10.000	Intrinsieke waarde per participatie:	EUR 790,2916
❖ Inschrijving:	maandelijks	Beheerd vermogen:	EUR 564.357

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%	-4.1%	+4.2%	-	-	-	-	-23.8%	-18.4%

Benchmark: Credit Suisse Hedge Fund Index, stijl Managed Futures (Eur)

Year	Jan	Feb	Mrt	Apr	Mei	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dec	YTD	Cum
2007	-	-	-	-	-	-	-	-4.8%	+4.8%	+3.9%	-1.0%	+0.3%	+2.9%	+2.9%
2008	+4.0%	+6.5%	-0.5%	-2.1%	+1.6%	+4.9%	-4.1%	-2.5%	-0.4%	+5.6%	+3.3%	+2.3%	+19.5%	+22.9%
2009	-0.5%	-0.1%	-2.0%	-3.2%	+0.8%	-2.3%	-0.4%	+0.9%	+3.0%	-2.2%	+4.9%	+9.6%	+8.1%	+32.9%
2010	-3.8%	+1.8%	+4.2%	+1.9%	-4.0%	+0.4%	-1.5%	+4.9%	+2.8%	+4.3%	-4.1%	+5.4%	+12.2%	+49.2%
2011	-0.8%	+2.6%	-2.7%	+5.2%	-4.5%	-3.1%	+3.6%	+1.0%	-0.1%	-5.1%	+0.2%	+1.8%	-2.4%	+45.6%
2012	+1.2%	+1.2%	-3.0%	+0.4%	+2.4%	-3.6%	+4.7%	-1.6%	-1.4%	-4.6%	+0.6%	+1.1%	-2.9%	+41.4%
2013	+2.7%	-0.8%	+1.7%	+3.5%	-5.0%	-5.4%	-1.1%	-2.8%	-0.2%	+3.0%	+2.1%	+0.1%	-2.6%	+37.8%
2014	-3.4%	+0.9%	-1.8%	+0.4%	+3.1%	+1.5%	-1.0%	+5.0%	+1.7%	+1.8%	+7.5%	+1.7%	+18.4%	+63.1%
2015	+6.0%	-1.2%	+2.4%	-4.3%	-0.8%	-5.8%	+4.3%	-2.8%	+2.9%	-2.5%	+3.7%	-2.2%	-0.9%	+61.6%
2016	+4.0%	+3.2%	-2.8%	-3.0%	-3.4%	+4.1%	+1.5%	-3.1%	-1.7%	-4.2%	-1.9%	+0.2%	-7.4%	+49.7%
2017	-1.6%	+2.3%	-2.0%	-0.7%	+0.3%	-3.4%	+1.1%	+2.6%	-2.8%	+4.9%	-0.3%	+1.5%	+1.6%	+52.0%
2018	+4.7%	-7.5%	-0.3%	-0.6%	-0.5%	+1.2%	-1.4%	+2.3%	-0.9%	-3.8%	-1.2%	+0.5%	-8.4%	+39.3%
2019*	-2.1%	+0.3%	+4.4%	+2.4%	-0.9%	+2.3%	+4.0%	+3.3%	-4.0%	-3.2%	+0.0%	+0.0%	+1.3%	+41.1%
2020	+1.1%	-1.7%	+0.1%	-1.0%	-0.7%	-1.5%	+2.6%	-	-	-	-	-	-1.3%	+39.3%

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

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