

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 staat onder toezicht van de AFM en DNB.

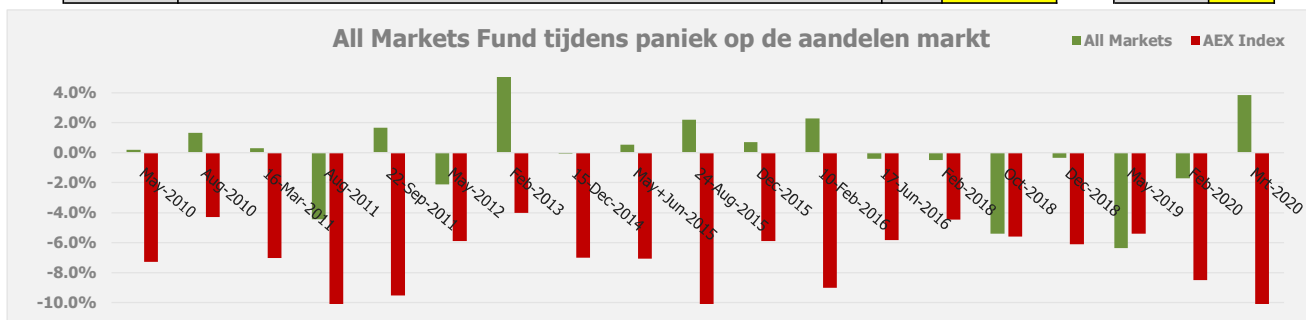
Maandcommentaar

Trump zorgde met zijn "Liberation Day" voor een inkt zwarte beurzen wereldwijd, waarbij Amerika nog harder werd geraakt dan de rest van de wereld, wat uiteindelijk niet zijn bedoeling was, want hij krabbelde (alweer) terug. Maar onze modellen waren goed gepositioneerd in de markt, het fonds stond de hele maand in de plus, ondanks dat de beurzen met 10% tijdens de maand onderuit gingen. De swingsystemen (handelsmodellen die aandelen kopen als ze laag staan en aandelen verkopen als ze relatief hoog staan) handelden volop en kregen prachtige kansen. Hierbij de deden de systemen die trade op de relatief kleinere aandelen (niet in de top 500 honderd) het weer beter dan de systemen op de SP500. Zo gingen we op 2 april short op Ralph Lauren Corp. tegen een prijs van \$233, om 2 dagen later terug te kopen op \$186. Op de obligatiemarkt werd een klein verlies geleden, toen de obligaties onderuit gingen en de limieten werden geraakt.

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	122,738
Minimum investering	EUR 5000	Intrinsieke waarde per participatie €	54.81
Inschrijving	Maandelijks	Beheerd vermogen	€ 13,485,389

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									-5%	120%	-2%	32%



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.