

Fondsstrategie

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

Maandcommentaar

De maand december is geëindigd in verlies. De belangrijkste reden is dat het voor de handelssystemen een grillige en onrustige maand en ook jaar is geweest. Grillig in de zin dat de S&P500 index zelfs binnen een beursdag van een forse winst positie kon omslaan naar een groot verlies. Terwijl de dag erna precies het tegenovergestelde gebeurde. Het gevolg was dat de algoritmen herhaaldelijk deze snelle wisselingen niet konden bijbenen en tegen verlies opliepen. Om deze problemen te tackelen krijgen de algoritmen die het afgelopen jaar goed functioneerden een dominantere positie in de handelssystemen. Zodoende verwachten we betere resultaten te kunnen realiseren.

Fondsgegevens

ISIN code	NL0009210053	Fund Manager	Elite Fund Management
Beheer- en prestatievergoeding*	2% / 20%	Portefeuille beheerder	Frans Schreiber, (Aat Schornagel, Peter Zwag)
In- of uitstapkosten	0.16%	Aantal participaties	787.5
Minimum investering	EUR 10000	Intrinsieke waarde per participatie	€ 82.24
Inschrijving	Maandelijks	Beheerd vermogen	€ 67,058

Rendementen Alpha Global Index Trader*

Year	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	Year	Cumulatief
2007								+6.6	-0.9	-7.7	+13.0	-0.9	9%	9%
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%	16%
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%	19%
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	8%	28%
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%	54%
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	-12%	36%
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%	36%
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	5%	42%
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	8%	53%
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	-7%	43%
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	-6%	35%
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%	6%
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	-3%	3%
2020	-2.9	+2.7	-29.4	-1.4	+9.0	+0.7	-4.1	+4.2	+2.2	-15.0	+7.3	-2.1	-30%	-28%
2021	+1.6	-0.5	-1.4	-0.9	-1.1	+0.4	-0.9	+0.0	-2.1	-4.2	-6.4	+1.6	-13%	-38%
2022	+3.3	-2.5	+3.1	-5.3	+7.7	+1.4	+1.1	-4.9	-10.6	+3.7	-0.4	-2.2	-3%	-39%
2023	-0.4	-0.4	-4.0	+0.4	+0.5	+1.1	+1.3	-1.0	-0.6	+0.7	+0.1	-1.1	-3%	-41%
2024	-2.1	-0.1	-0.5	+0.2	+0.6	-3.8	-12.0	+15.4	-5.0	-1.9	-3.0	-7.4	-18%	-7%

CS Managed Futures Index

Year	Cum
2007	3%
2008	19%
2009	8%
2010	12%
2011	-2%
2012	-3%
2013	-3%
2014	18%
2015	-1%
2016	-7%
2017	2%
2018	-8%
2019	6%
2020	0%
2021	8%
2022	18%
2023	-5%
2024	-10%

Bronnen: Elite Fund Management, Morningstar. Rendementen sinds start/inceptie van het fonds gemeten van maandeinde tot maandeinde. Alpha Future Spread 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. Prestatievergoeding wordt op basis van een "all-time high-water mark" berekend. : Per mei 2024 is een nieuwe portefeuillemanager aangetrokken en worden nieuwe strategieën toegepast, daarom wordt het rendement vanaf dat moment opnieuw berekend en weergegeven.