

# FB Opportunity Fund

FB Opportunity Fund – maksimaalse tootluse saavutamisele suunatud kõrge riskitasemega fond, kus on kasutusel keerulised kauplemisstrateegiaid, mis sisaldavad finantsvõimendust, lühikeseks müüki ja tuletisinstrumente. Fond investeerib vähemalt 80% oma aktiveerit USA aktsiaturu tuletisinstrumentidesse. Põhilised kauplemisinstrumentid on optsioonid USA fondituru juhtivatele indeksitele S&P 500 ja Russell 2000. Fondi eesmärk on aktiveerit maksumuse pikaajaline kasv koos pideva riskijuhtimisega.

## Miks FB Opportunity Fund?

1. Tänu spetsiaalsete investeerimisstrateegiatega rakendamisele suudab see fond teenida tulu nii kasvava kui ka kahaneva turusituatsiooni puhul.
2. Fond on likviidne instrument, kuna investoril on võimalus väljuda fondist üks kord kuus.
3. Fond kuulub madala kulutasemega fondide hulka (puuduvad fondi sisenemise ja fondist väljumise tasud ning juhtimistasu).
4. Fond töötab riskifondi põhimõttel. Kasutatav strateegia fondi algusest (7.03.2016) on näidanud kogutootlust 58%.

### Fondi Tootlus

Jooksva aasta algusest	10.587%
1 kuu	3.031%
1 aasta	17.044%
Fondi loomise hetkest	57.743%
Keskmine igakuine tootlus	1.430%

**2018 ▲ 14.461%**

**2017 ▲ 16.141%**

**2016 ▲ 17.876%**

### Fondi põhiandmed

Asutamise kuupäev	5. november 2015
Töö alustamise kuupäev	7. märts 2016
Registreerimise riik	Eesti
ISIN	EE3500110236
Registripidaja	Swedbank
Baasvaluuta	EUR
AUM	EUR 3,919,579
Minimaalne investeringusumma	EUR 100,000
Osaku maksumus	EUR 1,000
NAV <sup>1</sup> arvestusperiood	Iga kuu
Risk	Kõrge

### Osaku Hinnad

Kuupäev	31.08.2019
Osaku NAV	EUR 1464.8937
Osaku ost	EUR 1464.8937
Osaku müük	EUR 1464.8937
Sharpe'i suhtarv <sup>2</sup>	4.14
Fondi volatiilsus <sup>3</sup>	1.06

### Tasud

Juhtimistasu	–
Sisenemistasu	–
Väljumistasu	–
Tulemustasu: Moodustab 30% osaku puhas väärtuse tõusust üle selle ajaloolise kõrgeima kuu lõpu taseme.	

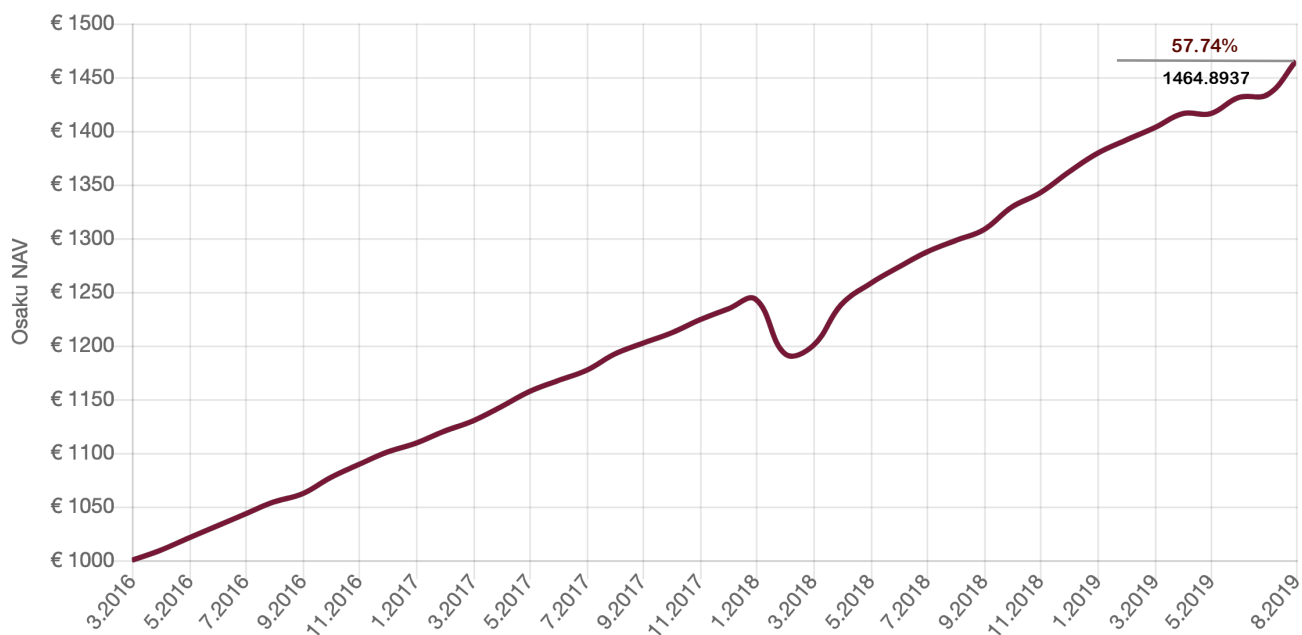
## FB Opportunity Fund kuuandmed

Aasta	jaan	vee	mär	apr	mai	juun	juul	aug	sep	okt	nov	det	Aasta tootlus
2019	1.765%	1.255%	1.213%	1.264%	0.006%	1.533%	0.248%	3.031%					10.587%
2018	1.120%	-4.280%	0.655%	3.054%	2.070%	1.698%	1.503%	1.274%	1.093%	2.215%	1.443%	2.088%	14.461%
2017	1.006%	1.451%	1.241%	1.624%	1.757%	1.207%	1.213%	1.748%	1.201%	1.228%	1.332%	1.146%	16.141%
2016			0.001%	1.270%	1.668%	1.596%	1.431%	1.474%	1.105%	1.966%	1.564%	1.613%	17.876%

## Hoiatus

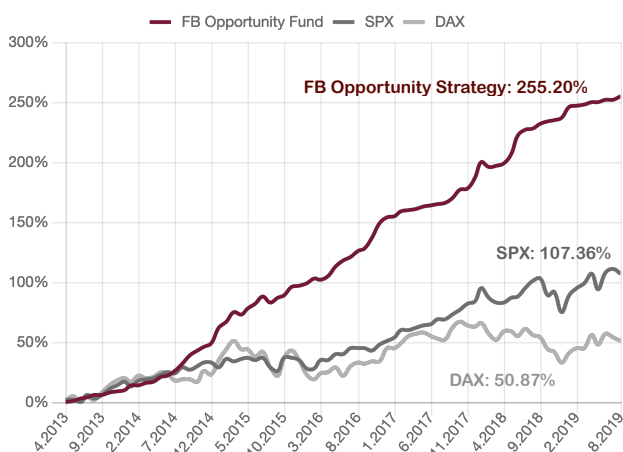
Fondi eelmiste perioodide tootlus ja senine tegevuse ajalugu kuni praeguse ajani ei tähenda lubadust ning ei ole indikaatoriks fondi järgmiste perioodide tootluse või tegevuse eesmärkide saavutamise kohta. Fondi eelkirjeldatud eesmärkide saavutamine ei ole tagatud.

## FB Opportunity Fund ajalooline tootlus



## FB Opportunity Strategia

Kuna fond on registreeritud 2015. aasta novembris, kuid tegelikult alustas tööd alles 2016. aasta märtsis, on fondi ajalugu alles loomisel. Fondi töö aluseks on strateegia, mis töötab alates 2013.



### Riski Analüüs

	DAX	SPX	FB Opportunity Strategy
Cumulative return:	50.87%	107.36%	255.20%
Max Drawdown:	20.19%	13.52%	5.62%
Peak-To-Valley:	Oct 17 – Dec 18	Sep 18 – Dec 18	Jul 15 – Aug 15
Recovery:	Ongoing	4 months	2 Months
Sharpe <sup>3</sup> Ratio:	0.37	0.90	2,01
Sortino <sup>4</sup> Ratio:	0.01	0.59	2.09
Standard Deviation:	4.38%	3.28%	2.80%
Downside Deviation:	3.05%	2.28%	1.86%
Mean Return:	0.64%	1,02%	1.92%
Positive Periods:	40 (52,63%)	55 (72,37%)	71 (93,42%)
Negative Periods:	36 (47,37%)	21 (27,63%)	5 (6,58%)

<sup>1</sup> NAV (aktivate pulhsmaksumus) – investeerimisfondi hind osakute arvestuses. Osaku maksumus arvutatakse, jagades fondi portfellis olevate kõigi väärtipaberite üldmaksumuse fondi käibivate osakute arvuga (arvates maha kõik kohustused).

<sup>2</sup> Sharpe'i suhtarv võrdleb investeeingu tootlust ja riski. Mida suurem on Sharpe'i suhtarv, seda parem on investeeingu tootlus, arvestades investeeingu riskitaset (ühe riskiühiku kohta).

<sup>3</sup> Fondi volatiilsus tähendab, kui kaugele fondi tulukõver eemaldub keskmisest tulususest teatud ajavahemiku jooksul, kaasa arvatud liikumine ainult alla. Fond, mille tulukõver on stabiilsem, on vähem riskantne, kuid fond, mille tulukõver on volatiilsem, on vastavalt ka riskantsem.

<sup>4</sup> Sortino suhtarv — kui Sharpe'i suhtarv võtab portfelli ülelilgise tulumäära arvestamisel aluseks riskivaba tulumäära, siis Sortino suhtarvus käsitletakse portfelli ülelilgset tulumäära läbi minimaalse nõutava tulunormi või võrdlusportfelli.