

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 aktivest USA aktsiaturu tuletisinstrumentidesse. Põhilised kauplemisinstrumentid on optsioonid USA fondituru juhtivatele indeksitele S&P 500 ja Russell 2000. Fondi eesmärk on aktive maksumuse pikaajaline kasv koos pideva riskijuhtimisega.

Miks FB Opportunity Fund?

1. Tänu spetsiaalsete investeerimisstrateegiate 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 53%.

Fondi Tootlus

Jooksva aasta algusest	5.319%
1 kuu	0.006%
1 aasta	16.037%
Fondi loomise hetkest	52.650%
Keskmine igakuine tootlus	1.400%

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 3,171,275
Minimaalne investeringussumma	EUR 100,000
Osaku maksumus	EUR 1,000
NAV ¹	lga kuu
arvestusperiood	
Risk	Kõrge

Osaku Hinnad

Kuupäev	31.05.2019
Osaku NAV	EUR 1415.9665
Osaku ost	EUR 1415.9665
Osaku müük	EUR 1415.9665
Sharpe'i suhtarv ²	4.05
Fondi volatiilsus ³	1.05

Tasud

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

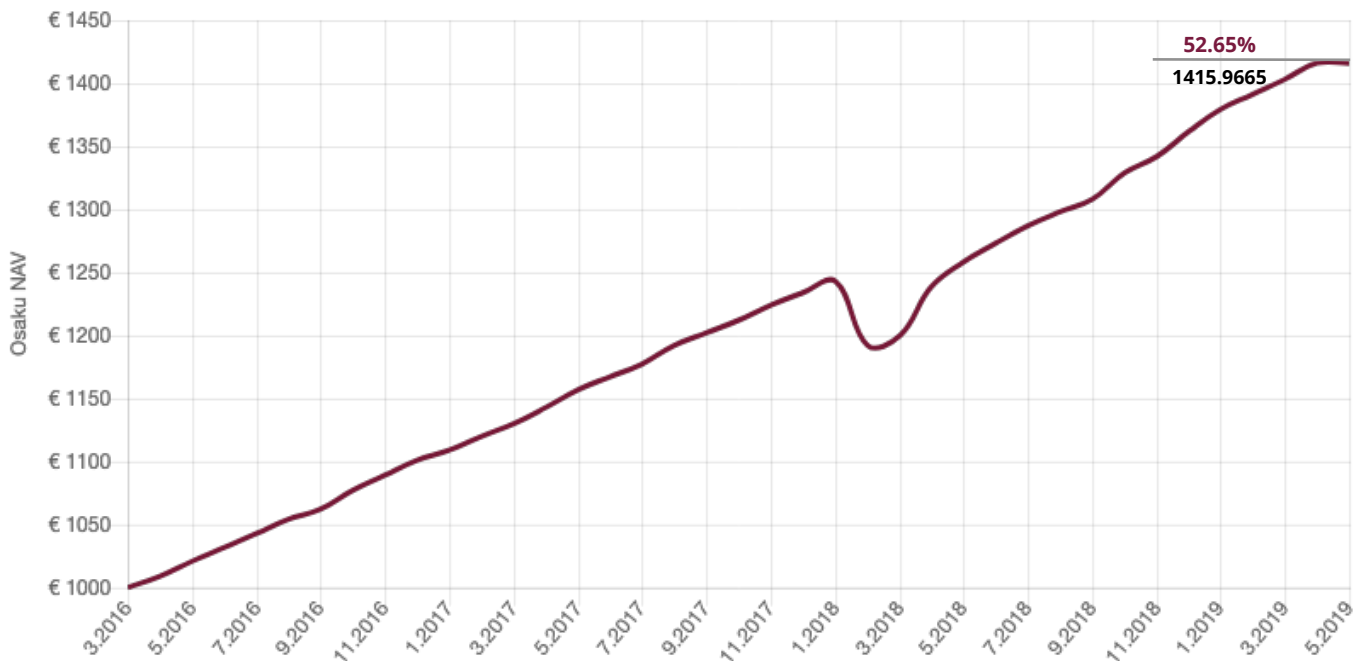
FB Opportunity Fund kuuandmed

Aasta	jaa	vee	mär	apr	mai	juu	juu	aug	sep	okt	nov	det	Aasta tootlus
2019	1.765%	1.255%	1.213%	1.264%	0.006%								5.319%
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%

Hoiatus

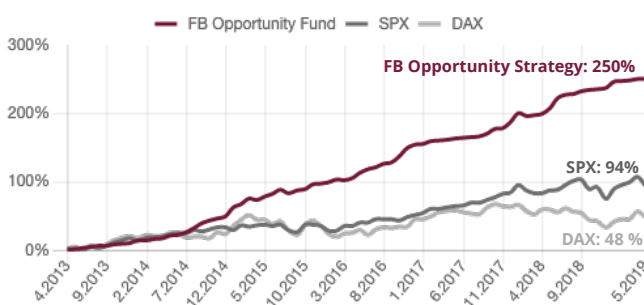
Fondi eelmiste perioodide tootlus ja senine tegevuse ajalugu kuni praeguse ajani ei tähenda lubadust ning ei ole indikaatoriks fondi järgmiste perioodide tootluse või tegevuse eesmärkide saavutamise kohta. Fondi eelkirjeldatud eesmärkide saavutamine ei ole tagatud.

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 alatest 2013.



Riski Analüüs	DAX	SPX	FB Opportunity Strategy
Cumulative return:	48.00%	94.00%	250.00%
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	Ongoing	2 Months
Sharpe ³ Ratio:	0.34	0.82	2.18
Sortino ⁴ Ratio:	0.10	0.51	2.91
Standard Deviation:	4.41%	3.26%	2.76%
Downside Deviation:	3.09%	2.32%	1.87%
Mean Return:	0.64%	0.97%	1.67%
Positive Periods:	39 (53.42%)	53 (72.60%)	68 (93.15%)
Negative Periods:	34 (46.58%)	20 (27.40%)	5 (6.85%)

¹ NAV (aktivate puhasmaksumus) – investeerimisfondi hind osakute arvestuses. Osaku maksumus arvutatakse, jagades fondi portfellis olevate kõigi väärtapaberite üldmaksumuse fondi käibivate osakute arvuga (arvates maha kõik kohustused).

² 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).

³ Fondi volatiilsus tähendab, kui kaugelt fondi tuluköver eemaldub keskmisest tulususest teatud ajavahemiku jooksul, kaasa arvatud liikumine ainult alla. Fond, mille tuluköver on stabiilsem, on vähem riskantne, kuid fond, mille tuluköver on volatiilsem, on vastavalt ka riskantsem.

⁴ Sortino suhtarv — kui Sharpe'i suhtarv võtab portfelli üleliigset tulumäära arvestamisel aluseks riskivaba tulumäära, siis Sortino suhtarvus käsitletakse portfelli üleliigset tulumäära läbi minimaalse nõutava tulunormi või võrdlusportfelli.