

STUDENT INVESTITOR

Osobna iskaznica na dan 31.05.2010.

Investicijski cilj

Osigurati rast ukupnog prinosa fonda ulaganjem u dionice izdavatelja iz 12 država Euro zone. Izloženost dionicama u svakom je trenutku najmanje 70% vrijednosti imovine, a novcu najviše 30% vrijednosti imovine.

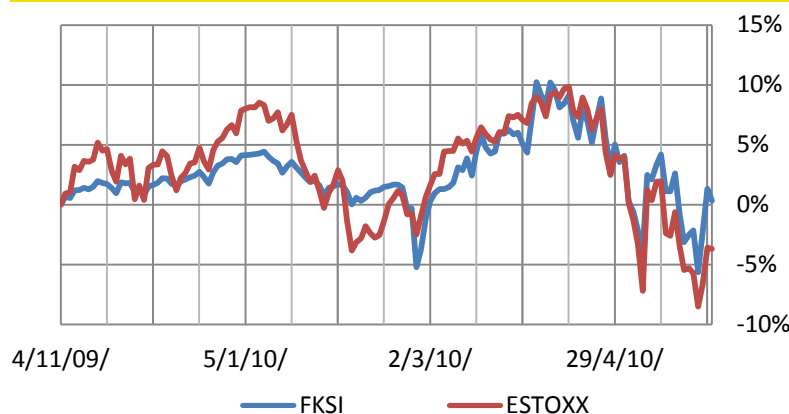
Osnovni podaci

Vrsta fonda	Dionički
Datum osnivanja	04.11.2009.
Starost fonda	0.57 god
Valuta fonda	EUR
Vrijeme ulaganja	Duže od 1 godine
Benchmark	DJ Euro Stoxx
Početna vrijednost	€100.000
Selekcija dionica	Top-down

Performanse fonda

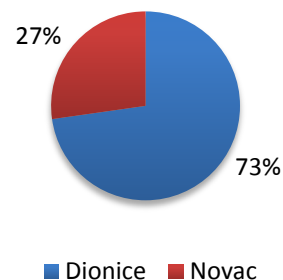
Prinos	1.50%
Rizik	6.12%
VaR	8.56%
Beta	0.70
Sharpe ratio	-0.11
Treynor ratio	-0.73
Information ratio	0.14
M ²	0.02

Kretanje vrijednosti fonda

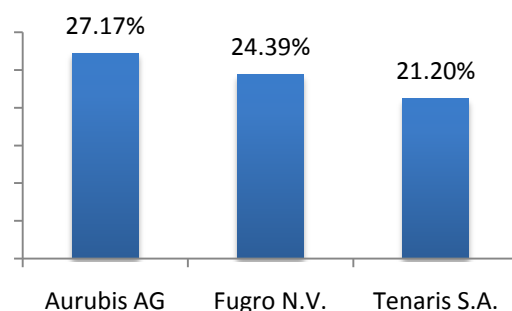


	FKS I	ESTOXX
Vrijednost	€100,353.68	249.80
1t%	2.94	1.71
1m%	-2.64	-6.01
6m%	-0.45	-4.05
Max%	0.35	-3.68

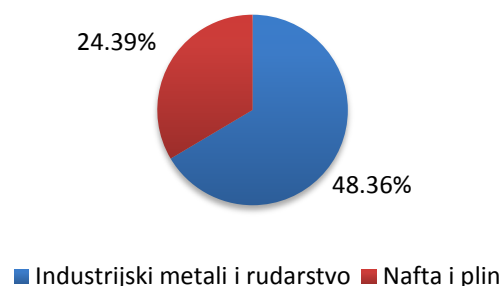
Alokacija imovine



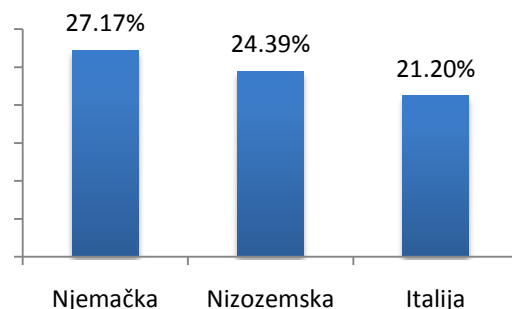
Pojedinačne dionice



Sektorska izloženost



Geografska izloženost



DODATAK

Student investor je analitički orijentiran projekt Financijskog kluba sa vizijom stvaranja najkvalitetnijih studentskih investicijskih analiza.

Projekt čini pet timova: Tim za makroanalizu, Tim za analizu industrije, Tim za analizu poduzeća, Tim za tehničku analizu te Tim za upravljanje portfeljem.

Osnovni podaci

* Države iz područja Euro zone su: Austrija, Belgija, Finska, Francuska, Njemačka, Grčka, Irska, Italija, Luksemburg, Nizozemska, Portugal i Španjolska.

Performanse fonda

- * Prinosi, standardne devijacije i mjere prikazani su na mjesečnoj osnovi.
- * Prinos je izračunat kao očekivani prinos portfelja.
- * Rizik je izračunat kao standardna devijacija portfelja.
- * VaR (Value at risk) je 5 postotni mjesečni.
- * Beta portfelja izračunata je na osnovi 6 mjesečnih prinosa fonda i indeksa.
- * Nerizičnu imovinu predstavljaju dvogodišnji Njemački državni trezorski zapisi.
- * Prosječna nerizična kamatna stopa iznosi 0.65%

