

SI EURO STOCKS

Osobna iskaznica na dan 30.11.2010.

Investicijski cilj

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

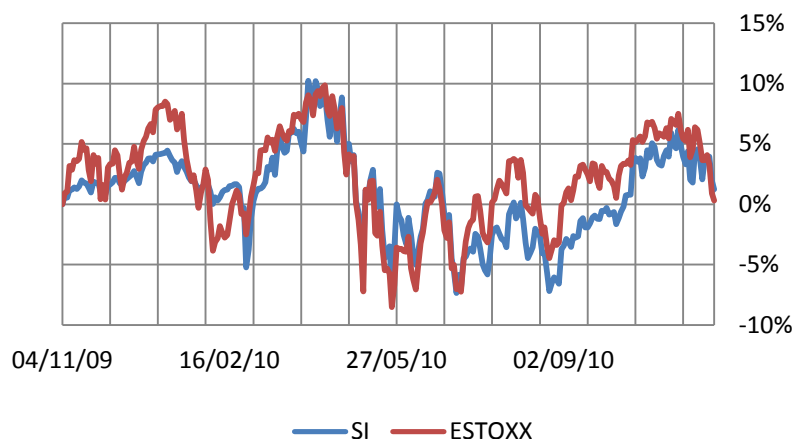
Osnovni podaci

Vrsta fonda	Dionički
Datum osnivanja	04.11.2009.
Starost fonda	0.82 god
Valuta fonda	EUR
Vrijeme ulaganja	Duže od 1 godine
Benchmark	DJ Euro Stoxx
Početna vrijednost	€100.000
Selekcija dionica	Top-down

Performanse fonda

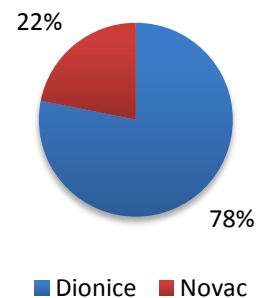
Prinos	0.79%
Rizik	4.84%
VaR	7.17%
Beta	0.71
Sharpe ratio	0.008
Treynor ratio	0.000
Information ratio	0.014
M ²	0.002

Kretanje vrijednosti fonda

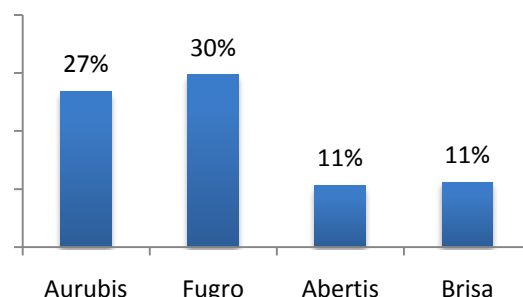


	SI	ESTOXX
Vrijednost	€101,241.16	260.19
1t%	-0.81	-3.21
1m%	-1.90	-5.16
6m%	2.59	4.15
Max%	1.24	0.32

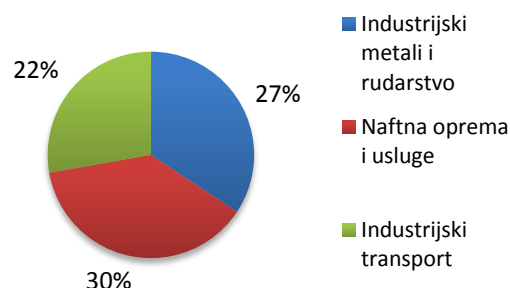
Alokacija imovine



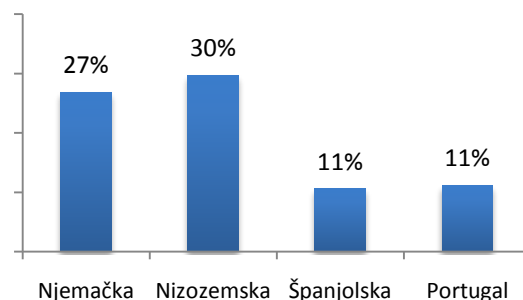
Pojedinačne dionice



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

- * Prinos, standardna devijacija 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.
- * Nerizičnu imovinu predstavlja dvogodišnja Njemačka državna obveznica.
- * Prosječan prinos nerizične imovine iznosi 0.20%



www.finance.hr

Financijski klub • info@finance.hr
Trg J.F. Kennedyja 6 • 10000 Zagreb • Hrvatska