

SI EURO STOCKS

Osobna iskaznica na dan 25.04.2011.

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 i obveznicama najviše 30% vrijednosti imovine.

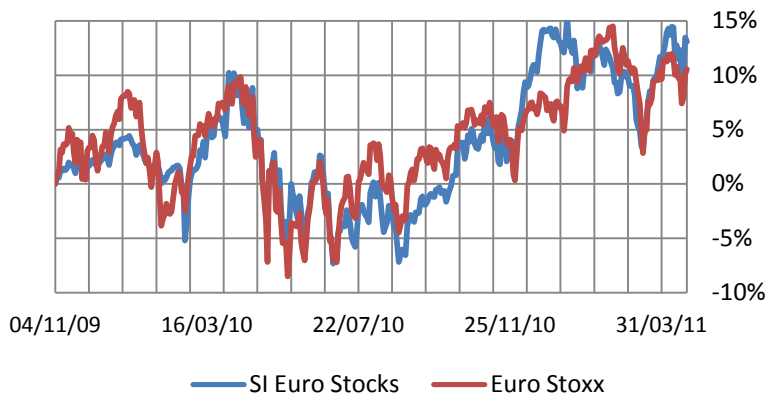
Osnovni podaci

Vrsta fonda	Dionički
Datum osnivanja	04.11.2009.
Starost fonda	1.50 god
Valuta fonda	EUR
Vrijeme ulaganja	Duže od 1 godine
Benchmark	DJ Euro Stoxx
Početna vrijednost	€100.000
Selekcija dionica	Top-down

Performanse fonda

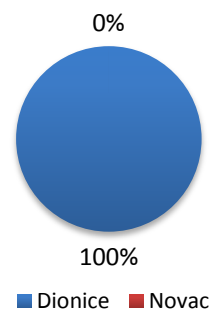
Prinos	-2.28%
Rizik	5.31%
VaR	11.00%
Beta	0.73
Sharpe ratio	0.16
Treynor ratio	0.01
Information ratio	0.03
M ²	0.01

Kretanje vrijednosti fonda

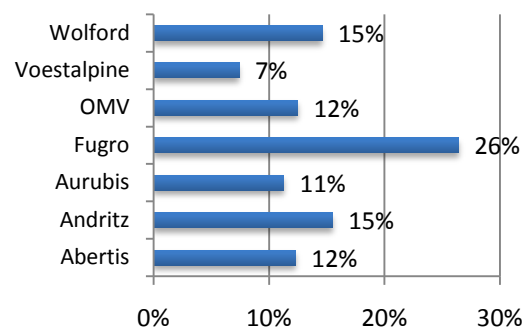


	SI Euro Stocks	EStoxx
Vrijednost	€113,096.21	286.75
1t%	1.42	0.76
1m%	5.17	2.72
6m%	8.23	3.54
Max%	13.10	10.56

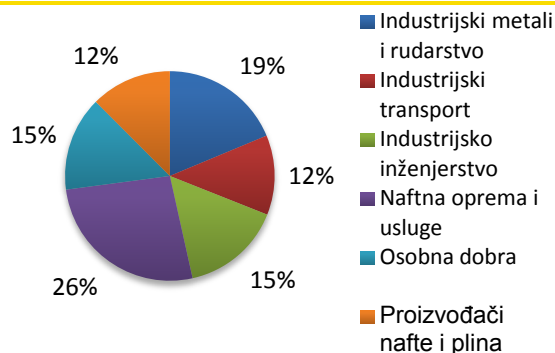
Alokacija imovine



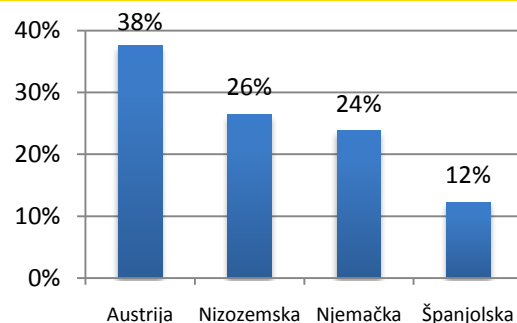
Pojedinačne dionice



Sektorska izloženost



Geografska izloženost



DODATAK

Student investitor 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.



www.finance.hr

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