

Falcon Europe Momentum



FALCON
INVEST

ISIN

DK0060854586

Beskrivelse

Afdelingens mål er at levere bedre langsigtede afkast end iShares STOXX® Europe 600 ETF (SXXPIEX GR), der dækker aktieindeks i 15 europæiske lande og cirka 85% af aktiemarkedsværdien heri. Strategien er løbende at omlægge porteføljen via risikojusteret momentum, således at der opnås eksponering mod de aktier i indeksene, der giver de bedste risikojusterede afkast. Der anvendes hverken afledte finansielle instrumenter, gearing eller shortselling. Strategien er udførligt beskrevet på www.falconinvest.dk

Risiko

1Y Alpha	-	1Y Sharpe Ratio	-
1Y Beta	-	1Y Std Dev	-
1Y R-squared	-	3 år risiko	-
1Y Info Ratio	-	5 år risiko	-
1Y Tracking Error	-	10 år risiko	-

Beregninger bruger MSCI Europe NR EUR (hvor passende)

Morningstar indeks

MSCI Europe NR EUR

Afkast

	2012	2013	2014	2015	2016	ÅTD	Vækst af 100 (DKK)
	-	-	-	-	-	-	● Fond
	-	-	-	-	-	-	● Indeks

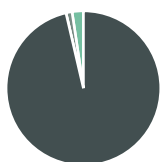
Løbende afkast %

	Fond	Indeks
1 uge	0,55	0,40
1 måned	2,80	2,70
3 måneder	-	-
6 måneder	-	-
1 år	-	-
3 år ann.	-	-
5 år ann.	-	-

Data fra 18-10-2017

Kvartalsafkast %	Q1	Q2	Q3	Q4
2017	-	-	-	-
2016	-	-	-	-
2015	-	-	-	-
2014	-	-	-	-
2013	-	-	-	-
2012	-	-	-	-

Portefølje 30-09-2017



Aktivfordeling

- Aktier
- Obligationer
- Kontant o. lign.
- Andet

Netto

Aktier	96,37
Obligationer	0,00
Kontant o. lign.	1,27
Andet	2,36

Aktiestil

Store	Mil.	Små
Værdi	Blend	Vækst
Aktietype		

Mkt Cap %

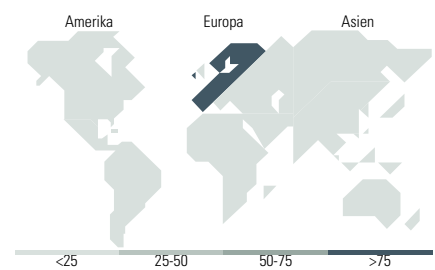
Fond	Fond
Gigant	18,52
Store	48,03
Mellem	32,88
Små	0,57
Mikro	0,00

Median markedsværdi (mio)

Fond	Fond
Ave Mkt Cap DKK	84349,7

Sektorsfordeling %

Fond	Fond
Cykliske	51,74
Materialer	9,92
Cyklisk forbrug	18,86
Finans	20,25
Ejendomme	2,71
Følsomme	35,35
Kommunikationsservice	3,43
Olie og gas	5,37
Industri	16,80
Teknologi	9,75
Defensive	12,91
Forbrugsvarer	2,50
Sundhed	10,40
Forsyning	-



Regionsfordeling

Fond	Fond
Amerika	5,40
USA	5,40
Canada	0,00
Central & Latinamerika	0,00
Europa inkl. Østeuropa	90,85
Storbritannien	5,01
Vesteuropa - Eurolande	58,19
Vesteuropa - ikke Eurolande	27,64
Nye markeder Europa	0,00
Afrika	0,00
Mellemøsten	0,00
Asien inkl. Fj.øst. & Japan	3,76
Japan	0,00
Australasien	0,00
Nye markeder 4 Tigre	3,76
Nye markeder Asien - ex 4 Tigre	0,00

Top 10 placeringer

Beholdning	Sektor	%
Ferrari NV	🚗	3,68
Kering SA	👔	3,64
STMicroelectronics NV	📱	3,62
Omv AG	🔥	3,51
Moncler SpA	👕	3,50
Atos SE	📄	3,38
Recordati	🏠	2,67
CA Immobilien Anlagen AG...	🏠	2,61
Storebrand ASA	🏠	2,59
GN Store Nord A/S	🏠	2,56
Aktiver blandt top 10 beholdninger %		17,94
Samlet antal aktiebeholdninger		64
Samlet antal obligationsbeholdninger		0

Risiko- og afkastprofil

◀ Lav risiko Høj risiko ▶



◀ Typisk lavt afkast Typisk højt afkast ▶

Management og omkostninger

Investeringsforening	Falcon Invest, Kapitalforeningen	Udb eller Akk	Akk
Startdato	07 sep 2017	Emissionstillæg	0,50%
Navn på manager	-	Indløsningsfradrag	0,50%
Manager start	07 sep 2017	Omkostningsprocent	-
Indre værdi (18 okt 2017)	DKK 104,15	Mindste første køb	100 DKK
Domicil	Danmark	Mindste tillægskøb	-
Valuta	DKK	ÅOP	2,32%
		Trafiklys	Gul