

Alken Fund - Absolute Return Europe Class A

Morningstar Categorie Index

Morningstar Developed Europe Target

Market Exposure NR EUR

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

Hurdle 5%

Morningstar Rating™

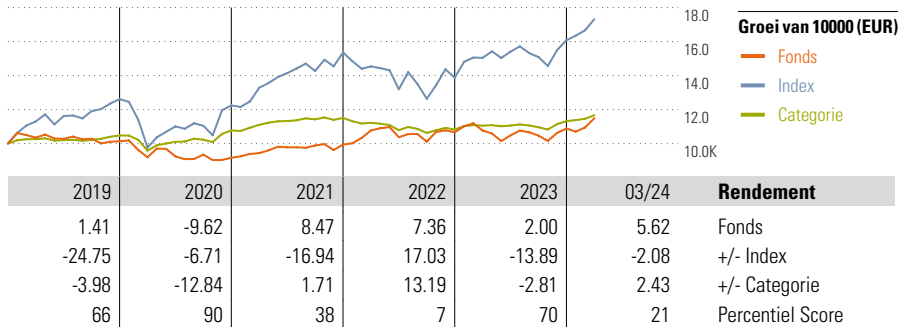
★★

Morningstar Categorie™

Alt - Long/Short Equity - Europe

Beleggingsdoelstelling

Provide capital growth and aim for a positive absolute return over long term period through long and short market exposure in the European markets primarily in equities or related derivative contracts. The Sub-Fund aims to typically deliver absolute (more than zero) returns in each year, although an absolute return performance is not guaranteed and over the short-term it may experience periods of negative return and consequently the Sub-Fund may not achieve this objective.

**Risicomaatstaven**

Alpha	1.77	Sharpe Ratio	0.60
Beta	0.48	Std Deviatie	9.73
R-kwadraat	44.12	3-jr Risico	Bov gem
Informatie Ratio	-0.24	5-jr Risico	Gem
Tracking Error	10.17	10-jr Risico	Hoog

Berekeningen met Morningstar DM Eur TME NR EUR (waar van toepassing)

Rendementen (25 apr 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	6.74	0.68	2.91
6 Maanden	13.29	-5.31	4.08
1 jaar	8.27	-4.62	1.76
3 jr gean.	6.02	-2.17	4.95
5 jr gean.	1.61	-6.49	-1.81

Kwartaalrendementen

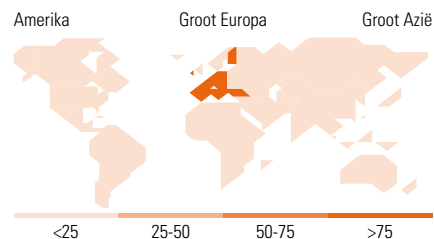
	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	5.62	-	-	-
2023	0.90	-2.65	-0.15	3.99
2022	8.35	-3.68	-2.58	5.59
2021	3.01	3.60	1.09	0.55
2020	-9.30	0.54	1.13	-2.00

Portefeuille 31 jul 2023

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	87.04	19.86	67.18
Obligaties	6.21	0.00	6.21
Kas/ geldmarkt	23.16	0.22	22.94
Overig	3.78	0.11	3.67

Morningstar Aandelen Style Box™

	% Aand
Zeer Groot	5.96
Groot	26.04
Midden	52.33
Klein	15.61
Micro	0.06
Gem Mkt Cap (mln)	EUR 6371

**Top 10 Onderliggende posities**

	Sector	% Port
Carrefour	🛒	5.40
Rheinmetall AG	⚙️	4.31
Vallourec SA	🏗️	3.95
Vallourec SA 8.5%2026-06-30	—	3.65
K+S AG	🏭	3.60
Societe Generale SA	🏦	3.48
Energie PLC	⚡	3.43
Elis SA	⚙️	3.24
Ryanair Holdings PLC	✈️	3.06
Technip Energies NV Ordinary...	⚡	3.01
Totaal Aantal Aandelen		61
Totaal Aantal Obligaties		2
% Van Vermogen In Top 10 Posities		37.15

Sectorverdeling

	% Aand
Cyclisch	33.92
Basismaterialen	13.64
Cyclische consumentenproducten	5.71
Financiële dienstverlening	12.16
Vastgoed	2.41
Licht Cyclisch	51.53
Communicatiediensten	-
Energie	15.60
Industrie	28.86
Technologie	7.07
Defensief	14.55
Defensieve consumptiegoederen	11.14
Gezondheidszorg	-
Nutsbedrijven	3.42

Regioverdeling

	% Aand
Amerika	3.71
Verenigde Staten	0.00
Canada	0.91
Latijns Amerika	2.80
Groot Europa	95.84
Verenigd Koninkrijk	8.65
West Europa – Euro	83.41
West Europa – Niet Euro	3.77
Emerging Europa	0.00
Midden-Oosten / Afrika	0.00
Groot Azië	0.46
Japan	0.00
Australazië	0.46
Azië - Ontwikkeld	0.00
Azië - Emerging	0.00

Fondsinformatie

Fondsgroep	AFFM SA	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	-
Telefoon	+352 260 967	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	-
Website	www.affm.lu	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	28 jun 2012	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Nicolas Walewski	ISIN	LU0572586591		
Aanvangsdatum	28 jan 2011				
Koers (25 apr 2024)	EUR 143.55				
Fondsvermogen (mln)	EUR 16.84				