

Alken Fund - Absolute Return Europe Class I

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

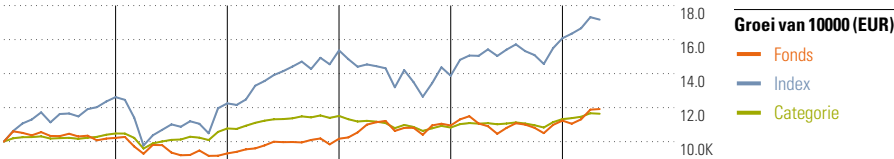
Beleggingsdoelstelling

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	2.30	Sharpe Ratio	0.61
Beta	0.46	Std Deviatie	9.42
R-kwadraat	43.57	3-jr Risico	Bov gem
Informatie Ratio	-0.13	5-jr Risico	Gem
Tracking Error	10.22	10-jr Risico	Hoog

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



	2019	2020	2021	2022	2023	04/24	Rendement
Fonds	2.18	-8.93	9.28	7.66	2.61	6.05	Fonds
+/- Index	-23.98	-6.02	-16.14	17.33	-13.27	-0.74	+/- Index
+/- Categorie	-3.21	-12.15	2.52	13.49	-2.19	3.07	+/- Categorie
Percentiel Score	64	87	37	7	66	16	Percentiel Score

Rendementen (3 mei 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	6.88	1.34	3.52
6 Maanden	11.16	-4.21	1.98
1 jaar	10.81	-1.54	3.15
3 jr gean.	6.69	-1.32	5.14
5 jr gean.	2.50	-5.50	-1.22

Kwartaalrendementen

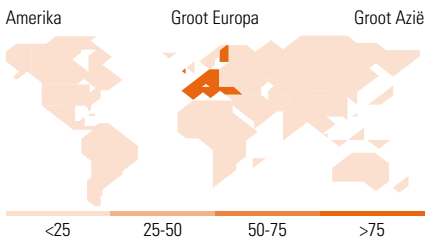
	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	5.75	-	-	-
2023	1.05	-2.32	0.04	3.91
2022	8.15	-3.37	-2.12	5.25
2021	3.19	3.80	1.28	0.73
2020	-9.12	0.73	1.31	-1.80

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	Supermarkten	5.40
Rheinmetall AG	Verdediging	4.31
Vallourec SA	Metaal	3.95
Vallourec SA 8.5%2026-06-30	Metaal	3.65
K+S AG	Metaal	3.60
Societe Generale SA	Banken	3.48
Energie PLC	Elektrische energie	3.43
Elis SA	Verkoop	3.24
Ryanair Holdings PLC	Verkeersvaartuigen	3.06
Technip Energies NV Ordinary...	Chemie	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 jan 2011	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Nicolas Walewski	ISIN	LU0572586674		
Aanvangsdatum	28 jan 2011				
Koers (3 mei 2024)	EUR 165.80				
Fondsvermogen (mln)	EUR 21.84				