All Markets Fund

Morningstar Medalist Rating™
Neutral

Morningstar Categorie Index
Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR
Wordt gebruikt in dit rapport als index

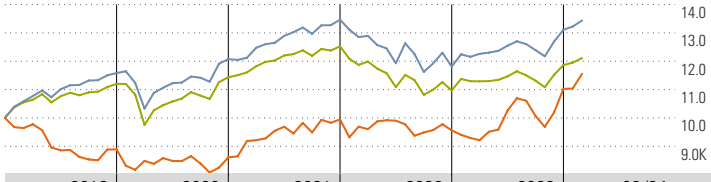
Benchmark van het fonds
Credit Suisse Hdg - Managed Futures

Morningstar Rating™
★★★★

Morningstar Categorie™
Mixfondsen EUR Flexibel

Beleggingsdoelstelling

Het All Markets Fund is een beleggingsfonds waarbij gehandeld wordt in diverse long/short-, long-only- en optiestrategieën in verschillende markten: obligaties, commodities, valuta's en aandelen. Door de ruime diversificatie van tradingsystemen in verschillende markten beoogt het fonds een hoger rendement (van tussen de 5 tot 10%) te behalen dan de desposito-rente. De rendementen van de systemen worden op kwartaalbasis geëvalueerd waarna er een herallocatie van de middelen kan plaatsvinden. Als margin worden in het...



2019	2020	2021	2022	2023	02/24	Rendement
-11.08	-3.18	15.53	-3.89	15.35	4.83	Fonds
-	-7.40	4.02	8.39	4.37	2.33	+/- Index
-23.41	-5.38	5.85	8.27	7.09	2.66	+/- Categorie
100	82	19	9	8	13	Percentiel Score

Risicomaatstaven

Alpha	5.80	Sharpe Ratio	0.64
Beta	0.54	Std Deviatie	11.53
R-kwadraat	16.20	3-jr Risico	Bov gem
Informatie Ratio	0.40	5-jr Risico	Gem
Tracking Error	11.20	10-jr Risico	Bov gem

Berekeningen met Morningstar EU Mod Gbl Tgt Alloc NR EUR (waar van toepassing)

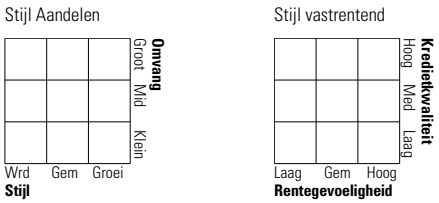
Rendementen (29 feb 2024)	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	13.32	8.79	8.82
6 Maanden	8.99	-1.64	-0.42
1 jaar	24.39	11.22	13.35
3 jr gean.	7.96	4.74	5.91
5 jr gean.	3.69	-1.32	0.21

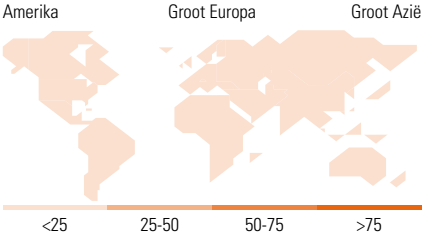
Kwartaalrendementen	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2023	-3.59	11.34	-1.86	9.51
2022	-3.43	3.09	-4.21	0.77
2021	7.05	5.13	-2.09	4.84
2020	-4.58	-0.01	-1.06	2.57
2019	-2.23	-9.44	-3.60	4.17

Portefeuille -

Assetverdeling % Long % Short % Netto

Morningstar Style Box





Geen data beschikbaar

Top 10 Onderliggende posities Sector % Port

Sectorverdeling % Aand

Cyclisch	**0.00**
Basismaterialen	-
Cyclische consumentenproducten	-
Financiële dienstverlening	-
Vastgoed	-
Licht Cyclisch	**0.00**
Communicatiediensten	-
Energie	-
Industrie	-
Technologie	-
Defensief	**0.00**
Defensieve consumptiegoederen	-
Gezondheidszorg	-
Nutsbedrijven	-

Fondsinformatie

Fondsgroep	Elite Fund Management	Vestigingsland	Nederland	Min Aanvangsbedrag	5,000
Telefoon	00 31 (0)72-220 19 03	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	2,500
Website	http://www.alphafondse...	UCITS	nee		
Oprichtingsdatum	9 sep 2003	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Frans Schreiber	ISIN	NL0001641263		
Aanvangsdatum	1 mei 2008				
Koers (29 feb 2024)	EUR 55.48				
Fondsvermogen (mln)	EUR 6.43				

© 2024 Morningstar Benelux. Alle rechten voorbehouden. De informatie aangaande beleggingsfondsen en de fondsportefeuille in dit document weergegeven: (1) is eigendom van Morningstar en is in licentie verstrekt, (2) mag uitsluitend gebruikt worden conform de contractueel opgestelde licentievoorwaarden, (3) dient informatieve doeleinden en mag niet opgevat worden als beleggingsadvies van Morningstar, (4) is met grote zorg samengesteld maar kan desondanks onjuistheden bevatten. Morningstar aanvaardt geen enkele aansprakelijkheid voor beslissingen gebaseerd op de weergegeven informatie.