



KUUKAUSIKATSAUS 31.12.2018

# FIM Multifactor Osake Eurooppa C

Faktoristrategiaa noudattava osakerahasto

## Perustiedot

### Rahastonhoitaja



Timo Rossi

Rahasto-osuuden arvo (EUR)	8,65
Rahaston pääoma (MEUR)	4
Osuudenomistajien lukumäärä	26
Elite-luokitus	-
Morningstar	
Palkkiot	
Merkintäpalkkio	0,00 %
Lunastuspalkkio	0,00 %
Hallinnointi- ja säilytyspalkkio	0,70 %

### Vertailuindeksi

MSCI Eurooppa TR Index 100,00 %

Noteerausvaluutta EUR

Aloituspäivä 17.9.2018

### Tunnisteet

ISIN FI4000327598

Bloomberg FIMMEUC FH Equity

## Rahastonhoitajan kommentti

Rahaston A-osuussarja tuotti -5,79 % ja C-sarja -5,77 % joulukuussa. Vertailuindeksi tuotti -5,53 %.

Joulukuussa faktoriominaisuuksiltaan Euroopassa parhaiten suhteessa koko markkinaan tuottivat momentum- (-4,9 %) ja laatuosakkeet (-5,0 %). Alhaisin tuotto vastaavasti oli arvo- (-5,9 %) ja kasvuyritysten osakkeilla (-5,3 %).

Rahaston osakkeista parhaiten tuottivat Anglo American (+10,3 %), Ericsson LM (+4,4 %) ja Rio Tinto (+3,6 %). Eniten laskivat Standard Life Aberdeen (-4,4 %), Faurecia (-3,9 %) ja Novo Nordisk (-2,6 %).

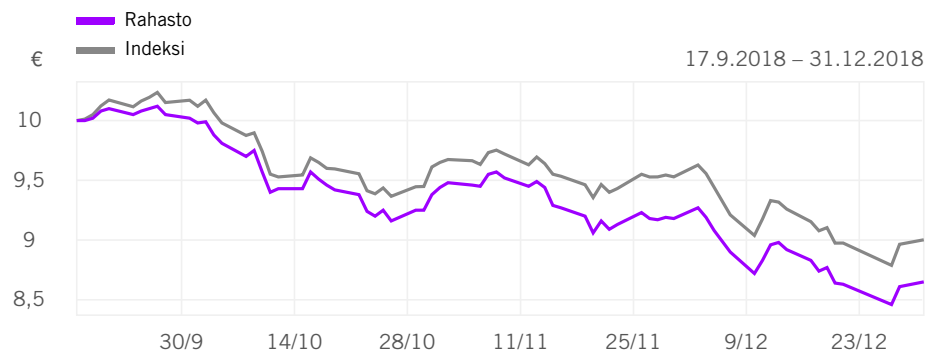
## Tuottokehitys

Jakso	Rahasto vuotuinen	Indeksi vuotuinen	Rahasto kumulat.	Indeksi kumulat.
1 kuukautta	-5,77 %	-5,53 %	-5,77 %	-5,53 %
3 kuukautta	-13,93 %	-11,32 %	-13,93 %	-11,32 %
12 kuukautta	-	-	-	-
3 vuotta	-	-	-	-
5 vuotta	-	-	-	-
vuoden alusta	-	-	-	-
alusta	-13,50 %	-9,98 %	-13,50 %	-9,98 %

## Kalenterivuositain

Vuosi	Rahasto	Indeksi
2011	-	-
2012	-	-
2013	-	-
2014	-	-
2015	-	-
2016	-	-
2017	-	-

## Historiallinen tuottokäyrä



## Suurimmat 10 sijoitusta

Arvopaperi	Toimiala	Maa	Nettoarvosta
------------	----------	-----	--------------

## Tunnusluvut

	Rahasto	Indeksi
<b>Volatiliteetti</b> – on riskimittari, joka kuvaa rahaston päivittäisen tuoton keskihajontaa kuluneelle 12 kuukaudelle	-	-
<b>Beta</b> – mittaa rahaston markkinariskiä ja sen tuoton riippuvuutta markkinoiden keskimääräisestä tuotosta.	-	-
<b>Sijoitusaste</b>	-	-
<b>Tracking Error</b> – kertoo, kuinka paljon rahaston tuotto on poikennut vertailuindeksin tuotosta.	-	-
<b>Informaatio-suhde</b> – on salkun ja indeksin tuottoeron suhde tracking erroriin. Se kertoo, kuinka paljon vuotuista lisätuottoa on saatu.	-	-
<b>Sharpen luku</b> – mittaa riskittömälle korolle saatua lisätuottoa suhteessa tuoton volatiliteettiin.	-	-
<b>Arvopapereiden lukumäärä</b>	-	-

Rahaston arvo lasketaan jokaiselle pankkipäivälle (arvostuspäivä).  
Rahaston arvo ilmoitetaan euroina.

