AMERIKANSK MOMENTUM A/S
FAKTAARK

INVESTERINGSSTRATEGI

Amerikansk Momentum har til formål at levere et absolut samt risikojusteret merafkast relativt til det amerikanske MSCI USA Indeks. Merafkastet genereres ved at anvende en forskningsbaseret momentumstrategi på likvide aktieselskaber børsnoteret i USA.

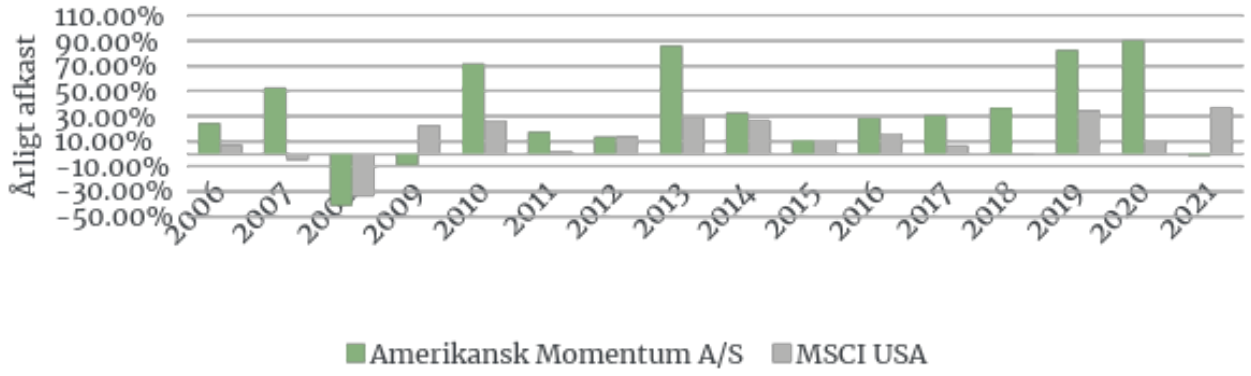
Den forskningsbaserede momentumstrategi identificerer først positive prissignaler blandt likvide amerikanske selskaber. Derefter valideres prissignalerne med statistisk metode, og vi inkluderer 10-20 aktier, der har overlegne prissignaler. Vi foretrækker en koncentreret portefølje på 10-20 aktier, da dette sikrer investoren et højt absolut samt risikojusteret merafkast.

DATA

(Opdateret d. 31. maj 2022)

AFKAST	Amerikansk Momentum A/S	MSCI USA	Risiko	Amerikansk Momentum A/S	MSCI USA
Afkast siden start	-16,75%	21,83%	1Y Std. afv. ann.	34,35%	19,73%
År-til-dato	-8,15%	-9,47%	3Y Std. afv. ann.	41,98%	24,73%
1 år	2,00%	10,80%	1Y Sharpe Ratio*	0,23	0,61
3 år	86,83%	62,88%	3Y Sharpe Ratio*	0,71	0,78

*Vi antager at den risikofrie rente er 0%.



RISIKO

1	2	3	4	5	6	7

← Typisk lavt afkast Typisk højt afkast →

Risikoen for afdelingen forventes at overstige referenceindekset. Risikoindikatoren 7 angiver at den forventede årlige volatilitet overstiger 25,00%. Investor kan tabe hele sin investerede kapital, men pådrager sig ikke yderligere forpligtelser end sin investerede kapital.

ADMINISTRATION OG OMKOSTNINGER

Afdeling:	Amerikansk Momentum A/S	Startdato:	02-02-2021	Emissionstillæg:	0,50%
Forvalter:	Alfa Formueforvaltning ApS	Udbytte:	Akkumulerende	Indløsningsfradrag:	0,50%
Hjemmeside:	www.alfaformue.dk	Minimuminvestering:	DKK 750.000	Fast månedligt honorar:	0,10%
Manager:	Ole Linnemann Nielsen	Indløsning:	Månedligt	Resultatbetinget honorar:	20,00%

© 2021 Alfa Formueforvaltning. Dette faktaark baserer sig på simuleret data indtil d. 02/02/2021. Arket er udarbejdet af Alfa Formueforvaltning ApS. Alle oplysninger er tilstræbt at være så virkelighedstro som muligt. For yderligere information, henvises der til Amerikansk Momentum A/S vedtægter samt øvrig investorinformation.