

TORRENOVA DE INVERSIONES, S.A., SICAV

Fondsbenchmark

Not Benchmarked

(Gültig für den gesamten Bericht)

Anlageziel

Sicav mit konservativem Risikoprofil. Gemischtes Portfolio aus festverzinslichen europäischen Papieren mit einem börsennotierten Anteil von 15% bis 40%. Die festverzinslichen Einlagen werden bei Emittenten mit hoher Solvenz und einer Laufzeit von 1,5 bis 3,5 Jahren getätigt.

Risikokennzahlen

Alpha	- Sharpe Ratio	0.24
Beta	- Std. Abweichung	3.93
R ²	- 3 J. Risiko	< 0
Information Ratio	- 5 J. Risiko	< 0
Tracking Error	- 10 J. Risiko	Niedrig

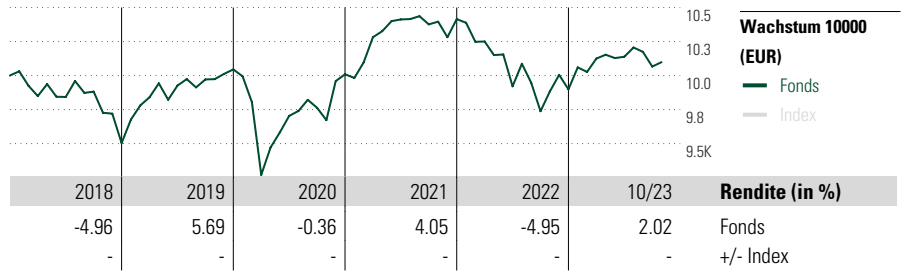
Berechnungsgrundlage Not Benchmarked (wenn zutreffend)

Morningstar Rating™

★★★★

Morningstar Kategorie™

Mischfonds EUR defensiv - Global



Rollierende Renditen (%)

	Fonds	+/-Idx
(31 Okt 2023)		
Lfd. Jahr	2.02	-
3 Monate	-1.05	-
6 Monate	-0.54	-
1 Jahr	2.19	-
3 Jahre p.a.	1.45	-
5 Jahre p.a.	0.75	-

Quartalsrenditen (%)

	1. Qtr	2. Qtr	3. Qtr	4. Qtr
2023	2.28	0.13	-0.71	-
2022	-1.58	-3.21	-1.85	1.65
2021	2.72	1.27	-0.35	0.37
2020	-7.72	4.68	0.61	2.53
2019	3.54	0.87	0.46	0.74

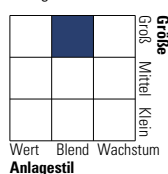
Portfolio 31 Okt 2023

Vermögensaufteilung (in %)

	% Long	% Short	% Netto
Aktien	12.94	0.00	12.94
Anleihen	77.33	0.04	77.29
Cash	29.56	19.83	9.73
Sonstige	0.05	0.00	0.05

Morningstar Style Box™

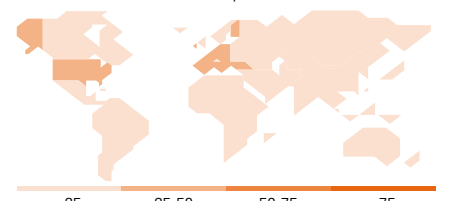
Anlagestil Aktien



Anlagestil Anleihen



Amerika Europa Asien



Top 10 Positionen (in %)

	Sektor	Portf.
France (Republic Of)2027-02-25	—	6.53
Spain (Kingdom of)2027-07-30	—	4.82
Germany (Federal Republic...)	—	4.71
France (Republic Of)2028-02-25	—	4.52
Future on 10 Year Treasury Note	—	3.78
United States Treasury...	—	3.75
France (Republic Of)2024-11-25	—	3.70
Spain (Kingdom of)2023-10-31	—	3.59
Spain (Kingdom of)2024-05-31	—	3.58
United States Treasury...	—	3.48
Positionen Aktien Gesamt		39
Positionen Anleihen Gesamt		60
% des Vermögens in Top 10 Positionen		42.47

Sektorengewichtung

	% Akt
Zyklisch	25.66
Rohstoffe	7.76
Konsumgüter zyklisch	8.97
Finanzdienstleistungen	8.74
Immobilien	0.19
Sensibel	33.91
Telekommunikation	6.54
Energie	6.40
Industriewerte	9.11
Technologie	11.86
Defensiv	40.43
Konsumgüter nicht zyklisch	18.03
Gesundheitswesen	17.24
Versorger	5.16

Regionen

	% Akt
Amerika	33.67
USA	28.37
Kanada	5.30
Lateinamerika	0.00
Europa	58.88
Vereinigtes Königreich	4.55
Eurozone	49.14
Europa - ex Euro	5.19
Europa - Schwellenländer	0.00
Mittlerer Osten / Afrika	0.00
Asien	7.45
Japan	3.36
Australasien	0.02
Asien - Industrieländer	0.25
Asien - Schwellenländer	3.83

Stammdaten

Fondsgesellschaft	March Asset Management SGIC	Domizil	Spanien
Internet	www.march-am.com	Währung	EUR
Auflegedatum	15 Jul 1993	UCITS	Ja
Fondsmanager	José Luis Palma	Ertragsverwendung	Thesaurierend
	Carlos Ruiz Antequera	ISIN	ES0179551231
NAV (31 Okt 2023)	10.67 EUR		
Fondsvolumen 2023-10-31 (Mio.)	1,018.90 EUR		