

# March International Torrenova Lux P USD Hedged Cap

## Fondsbenchmark

(Gültig für den gesamten Bericht)

### Anlageziel

Hauptziel der konservativen Absolute-Return-Verwaltungsstrategie sind die Erhaltung des Kapitals und die Wertschöpfung. Durch aktives Management und eine taktische Portfoliostrukturierung von traditionellen Instrumenten, die auf die hohe Qualität und Liquidität der Gegenparteien ausgerichtet sind (Währungs-, Anleihen- und globaler Anlagenmarkt), liegt das mittel- / langfristige Renditeziel bei Euro CPI + 2% bei einer Volatilität von weniger als 6%.

### Risikokennzahlen

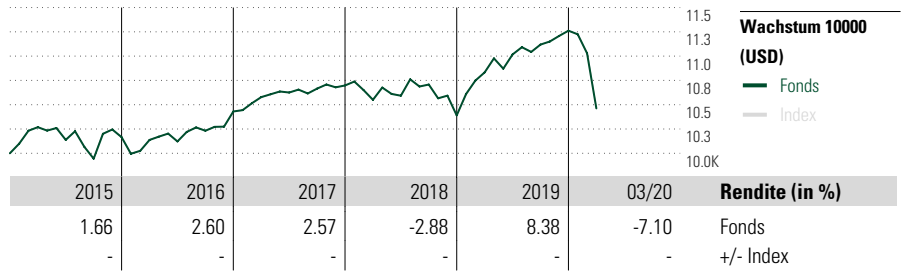
Alpha	- Sharpe Ratio	-0.47
Beta	- Std. Abweichung	4.36
R <sup>2</sup>	- 3 J. Risiko	< 0
Information Ratio	- 5 J. Risiko	< 0
Tracking Error	- 10 J. Risiko	-

## Morningstar Rating™

★★★

## Morningstar Kategorie™

Mischfonds USD defensiv



### Risikokennzahlen

Alpha	- Sharpe Ratio	-0.47
Beta	- Std. Abweichung	4.36
R <sup>2</sup>	- 3 J. Risiko	< 0
Information Ratio	- 5 J. Risiko	< 0
Tracking Error	- 10 J. Risiko	-

### Rollierende Renditen (%)

	Fonds	+/-Idx
(31 Mrz 2020)	-7.10	-
Lfd. Jahr	-7.10	-
3 Monate	-7.10	-
6 Monate	-5.91	-
1 Jahr	-3.42	-
3 Jahre p.a.	-0.37	-
5 Jahre p.a.	0.37	-

### Quartalsrenditen (%)

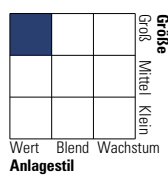
	1. Qtr	2. Qtr	3. Qtr	4. Qtr
2020	-7.10	-	-	-
2019	4.26	1.70	0.92	1.28
2018	-1.38	0.40	1.08	-2.96
2017	1.42	0.45	0.38	0.30
2016	-0.28	-0.15	1.09	1.94

## Portfolio 31 Mrz 2020

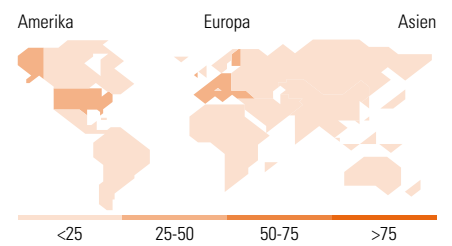
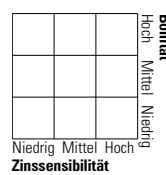
Vermögensaufteilung (in %)	% Long	% Short	% Netto
Aktien	16.45	0.00	16.45
Anleihen	60.04	0.00	60.04
Cash	30.11	6.63	23.48
Sonstige	0.04	0.00	0.04

## Morningstar Style Box™

Anlagestil Aktien



Anlagestil Anleihen



Top 10 Positionen (in %)	Sektor	Portf.
Criteria Caixa S.A., Sociedad...	-	2.84
Deutsche Bank AG	-	2.23
Bank of America Corporation	-	1.89
Turkey (Republic of)	-	1.84
Mylan NV	-	1.77
Muzinich Gbl Shrt...	-	1.50
Bnp Paribas Sa	-	1.46
FCC Aqualia S.A.	-	1.45
Banco Bilbao Vizcaya...	-	1.41
Ford Motor Credit Company LLC	-	1.38
Positionen Aktien Gesamt		37
Positionen Anleihen Gesamt		86
% des Vermögens in Top 10 Positionen		17.76

### Sektorengewichtung

	% Akt
<b>Zyklisch</b>	<b>24.53</b>
Rohstoffe	-
Konsumgüter zyklisch	9.31
Finanzdienstleistungen	15.21
Immobilien	-
<b>Sensibel</b>	<b>32.07</b>
Telekommunikation	15.48
Energie	6.63
Industriewerte	7.05
Technologie	2.91
<b>Defensiv</b>	<b>43.40</b>
Konsumgüter nicht zyklisch	26.04
Gesundheitswesen	10.95
Versorger	6.41

Regionen	% Akt
<b>Amerika</b>	<b>32.32</b>
USA	32.32
Kanada	0.00
Lateinamerika	0.00
<b>Europa</b>	<b>64.85</b>
Vereinigtes Königreich	12.70
Eurozone	49.24
Europa - ex Euro	2.91
Europa -Schwellenländer	0.00
Mittlerer Osten / Afrika	0.00
<b>Asien</b>	<b>2.83</b>
Japan	2.83
Australasien	0.00
Asien - Industrieländer	0.00
Asien - Schwellenländer	0.00

## Stammdaten

Fondsgesellschaft	FundRock Management Company S.A.	Domizil	Luxemburg	Einmalanlage	1,000,000
Internet	www.fundrock.com	Währung	USD	Weitere Anlagen	-
Auflegedatum	3 Apr 2014	UCITS	Ja	Rücknahme	-
Fondsmanager	Juan Carlos Acitores Juan Berberana Fernández	Ertragsverwendung	Thesaurierend	Rücknahme	-
NAV (31 Mrz 2020)	10.63 USD	ISIN	LU0982158676	Verwaltungsgebühr p.a. (max)	0.75%
Fondsvolumen (Mio.)	2020-03-31 454.67 EUR			Rücknahmegebühr	-
				Depotbankgebühr	-