

# March International Torrenova Lux Class P-EUR

## 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

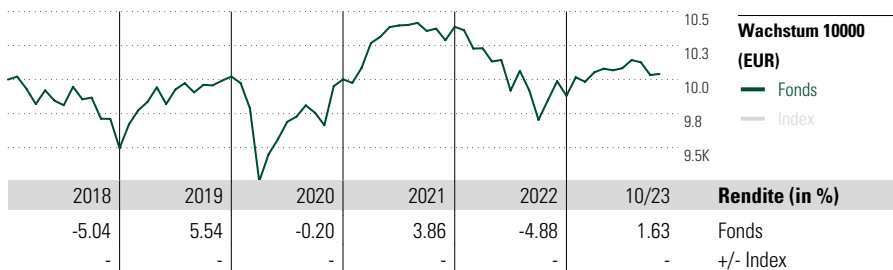
|                   |                   |      |
|-------------------|-------------------|------|
| Alpha             | - Sharpe Ratio    | 0.20 |
| Beta              | - Std. Abweichung | 3.77 |
| R <sup>2</sup>    | - 3 J. Risiko     | < 0  |
| Information Ratio | - 5 J. Risiko     | < 0  |
| Tracking Error    | - 10 J. Risiko    | -    |

## Morningstar Rating™

★★★★

## Morningstar Kategorie™

Mischfonds EUR defensiv - Global



Wachstum 10000 (EUR)

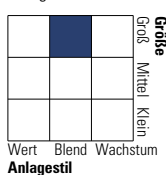
Rendite (in %)

## Portfolio 31 Okt 2023

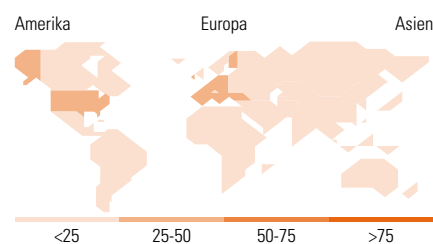
| Vermögensaufteilung (in %) | % Long | % Short | % Netto |
|----------------------------|--------|---------|---------|
| Aktien                     | 11.91  | 0.00    | 11.91   |
| Anleihen                   | 65.33  | 0.04    | 65.29   |
| Cash                       | 40.29  | 17.53   | 22.76   |
| Sonstige                   | 0.05   | 0.00    | 0.05    |

## Morningstar Style Box™

Anlagestil Aktien



Anlagestil Anleihen



| Top 10 Positionen (in %)             | Sektor | Portf. |
|--------------------------------------|--------|--------|
| Spain (Kingdom of)2024-05-31         | —      | 6.27   |
| France (Republic Of)2023-10-25       | —      | 4.89   |
| France (Republic Of)2024-11-25       | —      | 4.81   |
| Italy (Republic Of)2023-11-29        | —      | 3.59   |
| United States Treasury...            | —      | 3.52   |
| Future on 10 Year Treasury Note      | —      | 3.40   |
| Spain (Kingdom of)2027-07-30         | —      | 3.16   |
| France (Republic Of)2027-02-25       | —      | 2.94   |
| Germany (Federal Republic...)        | —      | 2.89   |
| Netherlands (Kingdom...)             | —      | 2.75   |
| Positionen Aktien Gesamt             |        | 39     |
| Positionen Anleihen Gesamt           |        | 54     |
| % des Vermögens in Top 10 Positionen |        | 38.22  |

## Sektorengewichtung

| Sektor                     | % Akt        |
|----------------------------|--------------|
| <b>Zyklisch</b>            | <b>25.51</b> |
| Rohstoffe                  | 7.66         |
| Konsumgüter zyklisch       | 8.95         |
| Finanzdienstleistungen     | 8.71         |
| Immobilien                 | 0.20         |
| <b>Sensibel</b>            | <b>33.88</b> |
| Telekommunikation          | 6.48         |
| Energie                    | 6.26         |
| Industriewerte             | 9.06         |
| Technologie                | 12.08        |
| <b>Defensiv</b>            | <b>40.61</b> |
| Konsumgüter nicht zyklisch | 18.07        |
| Gesundheitswesen           | 17.41        |
| Versorger                  | 5.13         |

| Regionen                 | % Akt        |
|--------------------------|--------------|
| <b>Amerika</b>           | <b>33.66</b> |
| USA                      | 28.46        |
| Kanada                   | 5.19         |
| Lateinamerika            | 0.00         |
| <b>Europa</b>            | <b>58.75</b> |
| Vereinigtes Königreich   | 4.66         |
| Eurozone                 | 48.97        |
| Europa - ex Euro         | 5.13         |
| Europa -Schwellenländer  | 0.00         |
| Mittlerer Osten / Afrika | 0.00         |
| <b>Asien</b>             | <b>7.59</b>  |
| Japan                    | 3.35         |
| Australasien             | 0.02         |
| Asien - Industrieländer  | 0.26         |
| Asien - Schwellenländer  | 3.97         |

## Stammdaten

|                     |                                       |                   |               |
|---------------------|---------------------------------------|-------------------|---------------|
| Fondsgesellschaft   | March Asset Management SGIC           | Domizil           | Luxemburg     |
| Internet            | www.march-am.com                      | Währung           | EUR           |
| Aufgagedatum        | 15 Nov 2013                           | UCITS             | Ja            |
| Fondsmanager        | José Luis Palma Carlos Ruiz Antequera | Ertragsverwendung | Thesaurierend |
| NAV (31 Okt 2023)   | 10.86 EUR                             | ISIN              | LU0982160227  |
| Fondsvolumen (Mio.) | 2023-10-31: 353.97 EUR                |                   |               |