

SMN Diversified Futures Fund 1996 (LU0070804173)

KAG: SMN Inv. Services

ISIN: LU0070804173

Rücknahmepreis: 401,37 EUR

Stand: 10.05.2024

| | |
|--|--------------------|
| Auflagedatum | 31.10.96 |
| Ausgabeaufschlag | 5,00% |
| Konditionsdetails auf www.easybank.at | |
| Fondsvolumen | 71.43 Mio. |
| Ertragstyp | thesaurierend |
| Letzte Ausschüttung | keine |
| Anlageregion | weltweit |
| Fondstyp | AI Managed Futures |
| Fondsmanager | n.a |
| Kapitalanlagegesellschaft | |
| SMN Inv. Services | |
| Rotenturmstraße 16-18 | |
| 1010 Wien | |
| Österreich | |
| https://www.smn.at | |



| Wertentwicklung* | 1J | 3J p.a. | 5J p.a. |
|---------------------------|---------|---------|---------|
| Performance vor AGA | +5,48% | +15,07% | +10,12% |
| Performance nach max. AGA | +0,45% | +13,22% | +9,05% |
| Kennzahlen* | 1J | 3J | 5J |
| Sharpe Ratio | 0,17 | 0,72 | 0,36 |
| Volatilität | +10,10% | +15,70% | +17,69% |

* Performanceergebnisse der Vergangenheit lassen keine Rückschlüsse auf die künftige Entwicklung zu.

Fondsstrategie

Der Fonds strebt dynamisches Kapitalwachstum an. Der Fonds investiert breit über verschiedene Anlageklassen gestreut in ein Portfolio aus weltweit gehandelten liquiden Futures und Forwards. Ziel des Handelssystems ist es, innerhalb vordefinierter Grenzwerte Erträge aus direktionalen Preisbewegungen - unabhängig von deren Richtung - zu erzielen. Dies ermöglicht eine von traditionellen Anlageinstrumenten weitgehend unabhängige Wertentwicklung. Zur Absicherung von Fremdwährungsrisiken werden ebenfalls derivative Finanzinstrumente verwendet. Die Anlagestrategie des Fonds basiert auf systematischer Trendfolge. Die praktische Umsetzung erfolgt mittels eines computergestützten Handelssystems. Generell kann der Fonds zur Liquiditätsverwaltung bis zu 100% des Fondsvermögens in Barmittel veranlagen. Als Barmittel gelten Bankguthaben, kurzlaufende Staatspapiere, Forderungspapiere oder gleichgestellte Papiere, sofern diese eine gute Bonität aufweisen und liquide sind, Geldmarkt-Fonds oder andere Fonds mit vergleichbarer Bonität.

Kommentar:

Fondsspezifische Information

Im Rahmen der Anlagestrategie kann in wesentlichem Umfang in Derivate investiert werden.

Anlagearten



Größte Positionen



Länderverteilung



Branchenverteilung



Historische Daten: 05/2024

Erstellt: 19.05.2024 18:58