

# Most Diversified Portfolio SICAV - TOBAM Anti-Benchmark Euro Equit

KAG: TOBAM

ISIN: LU1067854650

Rücknahmepreis: 13276,77 EUR

Stand: 07.11.2024

Auflagedatum	30.06.06
Ausgabeaufschlag	-
Konditionsdetails auf <a href="http://www.easybank.at">www.easybank.at</a>	
Fondsvolumen	-
Ertragstyp	thesaurierend
Letzte Ausschüttung	keine
Anlageregion	Europa
Fondstyp	Branchenmix
Fondsmanager	n.a
<b>Kapitalanlagegesellschaft</b>	
TOBAM	
49-53	
Avenue des Champs-Élysées 75008	
Frankreich	
<a href="http://www.tobam.fr">www.tobam.fr</a>	



<b>Wertentwicklung*</b>		<b>1J</b>	<b>3J p.a.</b>	<b>5J p.a.</b>
Performance	vor AGA	+11,06%	-2,81%	-1,71%
Performance	nach max. AGA	+11,06%	-2,81%	-1,71%
<b>Kennzahlen*</b>		<b>1J</b>	<b>3J</b>	<b>5J</b>
Sharpe Ratio		0,98	-0,49	-0,34
Volatilität		+8,18%	+12,03%	+14,17%

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

## Fondsstrategie

Das vorrangige Anlageziel des Produkts besteht in der Anlage in Aktien der Eurozone, wobei der von der Verwaltungsgesellschaft entwickelte Anlageprozess systematisch angewendet wird, um den Referenzindex zu übertreffen, indem die Konzentration von Risikofaktoren durch ein maximal diversifiziertes Portfolio minimiert wird. Die Aktienauswahl basiert auf den quantitativen und systematischen Modellen, die darauf abzielen, den im Verhältnis zum Benchmarkindikator erzielten Grad der Diversifikation zu optimieren. Diese Modelle bestimmen das optimale Modellportfolio, einschließlich der Liste der in Frage kommenden Aktien und ihrer Gewichtungen innerhalb des Portfolios. Es wird erwartet, dass das hieraus resultierende Produkt die Ergebnisse der Anlageallokation verbessert, indem unter anderem die Sharpe-Ratio verbessert und die Volatilität reduziert wird. Das Produkt wird unter Bezugnahme auf den Bloomberg Eurozone Developed Markets Large & Mid Cap Net Return Index verwaltet. Das Produkt verwendet keine indexbasierte Verwaltungsstrategie, sondern wird aktiv verwaltet. Infolgedessen kann seine Performance erheblich von der Benchmark abweichen, die zur Definition des Anlageuniversums und zur Bestimmung des globalen Risikoprofils des Produkts verwendet wird. Ein Großteil der Aktienwerte der Benchmark werden Bestandteile des Produkts sein. Die Gewichtungen der Portfoliopositionen des Produkts können erheblich von ihren entsprechenden Gewichtungen im Index abweichen.

## Kommentar:

## Fondsspezifische Information

Im Rahmen der Anlagestrategie kann in wesentlichem Umfang in Derivate investiert werden. Die Fondsbestimmungen des Most Diversified Portfolio SICAV - TOBAM Anti-Benchmark Euro Equity Fund A EUR wurden durch die FMA bewilligt. Der Most Diversified Portfolio SICAV - TOBAM Anti-Benchmark Euro Equity Fund A EUR kann mehr als 35 % des Fondsvermögens in Wertpapiere/Geldmarktinstrumente folgender Emittenten investieren: by a Member State, by its local authorities or agencies, or by another member State of the OECD, the G20 or Singapore or by public international bodies of which one or more member states of the EU, provided that.

### Anlagearten



### Größte Positionen



### Länderverteilung



### Branchenverteilung



Historische Daten: 11/2024

Erstellt: 09.11.2024 02:11