

smn DIVERSIFIED FUTURES FUND "1996"

Performancebericht Februar 2025

Portfolio Selection SICAV

ISIN: LU0070804173 Bloomberg: SMNDIVF LX

PERFORMANCE (netto)

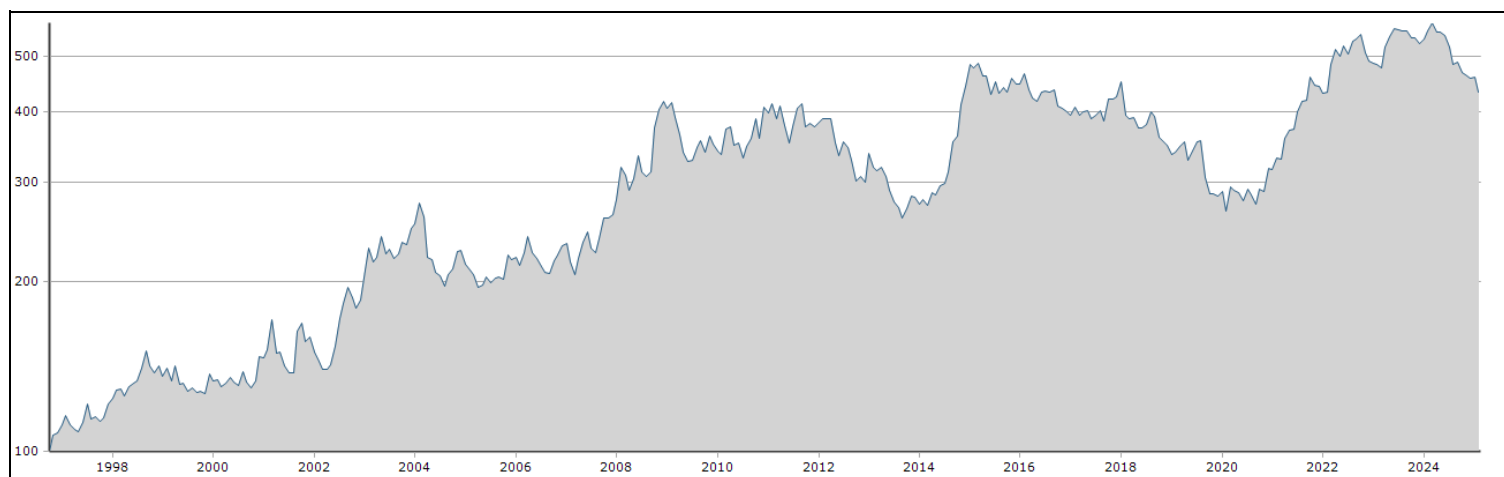
Nettovermögenswert	Februar 2025	2025 (Year to Date)	seit Fondsbeginn (Nov. 1996)
EUR 314,72	-5,75%	-5,17%	333,08%

INVESTMENTSTRATEGIE

Der **smn** Diversified Futures Fund ist ein Managed Futures Fonds (CTA) mit breit diversifizierter Anlagestrategie. Der Fonds investiert in liquide Terminkontrakte an den wichtigsten Finanz- und Rohstoffmärkten. Das Anlagekonzept verfolgt einen mittel- bis langfristigen Trendfolgeansatz und ermöglicht mittels technischer

Handelsmodelle und systematischem Risikomanagement Erträge in steigenden wie auch in fallenden Märkten. Managed Futures Fonds eignen sich aufgrund ihrer geringen Korrelation zu traditionellen Anlageklassen hervorragend als strategisches Diversifizierungsinstrument.

KUMULIERTER ERTRAG (netto)



PERFORMANCEBEITRÄGE NACH SEKTOREN

	MTD	YTD
Währungen	o	-
langfristige Zinsmärkte	o	o
Kurzfristige Zinsmärkte	o	o
Aktienindizes	o	+
Aktien/Volatilität	o	-
Agrargüter	--	--
Energie	o	o
Fleischmärkte	--	o
Soft Commodities	-	o
Metalle	o	o
synthetische Märkte	-	--

- negativ o neutral + positiv

KENNZAHLEN

	seit Auflage
Durchschn. Ertrag p.a.	5,31%
Annualisierte Volatilität	18,18%
Maximum Drawdown	-45,42%
Modified Sharpe Ratio	0,29
MAR Ratio	0,12

KONTAKT

smn INVESTMENT SERVICES GMBH
 Rotenturmstraße 16-18 | A-1010 Wien
 T +43 1 513 25 51 | F +43 1 513 79 41
www.smn.at | office@smn.at



MONATLICHE PERFORMANCE (netto)

	Jan	Feb	Mrz	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	Jahr
1996	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	6,69%	0,97%	7,72%
1997	3,37%	3,83%	-3,39%	-2,24%	-1,01%	3,90%	7,85%	-5,69%	0,60%	-1,76%	1,61%	5,69%	12,54%
1998	2,47%	3,47%	0,39%	-2,77%	3,51%	1,73%	0,68%	5,37%	7,30%	-5,75%	-2,69%	2,67%	16,80%
1999	-4,15%	3,35%	-4,88%	6,28%	-7,29%	0,21%	-2,99%	1,55%	-1,88%	0,13%	-0,60%	8,01%	-3,31%
2000	-2,85%	0,88%	-3,16%	1,48%	2,38%	-1,59%	-1,48%	5,66%	-4,10%	-2,36%	3,09%	10,28%	7,53%
2001	-0,50%	3,33%	12,93%	-12,71%	0,49%	-5,30%	-3,20%	0,12%	18,43%	3,37%	-7,16%	1,76%	8,10%
2002	-5,63%	-2,87%	-4,16%	0,07%	1,98%	7,40%	11,96%	6,66%	6,51%	-3,87%	-4,15%	3,26%	16,51%
2003	13,07%	9,39%	-5,66%	1,90%	8,70%	-6,52%	1,84%	-3,59%	1,48%	5,25%	-1,14%	6,89%	33,88%
2004	1,84%	8,73%	-5,54%	-15,18%	-1,01%	-4,72%	-1,54%	-4,22%	5,14%	2,26%	7,45%	0,07%	-8,78%
2005	-5,32%	-2,41%	-1,76%	-5,18%	1,25%	3,29%	-2,30%	1,82%	0,33%	-0,76%	10,37%	-2,11%	-3,66%
2006	1,19%	-3,48%	5,30%	6,77%	-6,37%	-2,09%	-3,15%	-2,41%	-0,63%	5,23%	2,80%	3,70%	6,07%
2007	1,03%	-7,52%	-4,80%	6,71%	6,75%	4,47%	-6,46%	-1,93%	5,79%	8,82%	0,01%	1,58%	13,55%
2008	6,45%	13,93%	-3,36%	-6,06%	5,12%	9,63%	-6,30%	-1,83%	1,71%	19,70%	7,91%	3,39%	58,52%
2009	-2,79%	2,47%	-6,19%	-6,68%	-6,69%	-3,67%	0,13%	5,65%	2,56%	-4,54%	6,89%	-3,06%	-15,88%
2010	-2,86%	-1,27%	10,44%	0,99%	-7,12%	1,20%	-6,26%	5,13%	3,10%	8,55%	-7,63%	13,26%	16,01%
2011	-2,12%	3,45%	-5,90%	5,51%	-7,64%	-6,81%	6,94%	7,79%	1,77%	-8,92%	1,34%	-1,56%	-7,77%
2012	2,08%	1,39%	0,10%	-0,34%	-9,29%	-5,12%	5,79%	-2,06%	-5,30%	-7,88%	1,87%	-2,36%	-20,12%
2013	12,57%	-5,53%	-1,22%	1,23%	-3,75%	-5,56%	-4,34%	-2,36%	-4,04%	3,38%	5,39%	-0,36%	-5,95%
2014	-2,90%	1,95%	-2,20%	5,22%	-0,95%	3,85%	1,01%	5,03%	12,64%	2,38%	13,69%	7,92%	57,30%
2015	9,34%	-1,68%	2,29%	-5,15%	-0,19%	-7,02%	5,38%	-4,79%	2,60%	-2,19%	6,10%	-2,40%	0,91%
2016	-0,03%	4,23%	-6,18%	-3,45%	-1,27%	3,67%	0,76%	-0,73%	1,06%	-6,41%	-0,92%	-1,19%	-10,53%
2017	-1,61%	3,50%	-3,18%	1,32%	0,51%	-3,23%	1,45%	1,79%	-4,41%	9,34%	0,05%	1,05%	6,02%
2018	6,46%	-12,78%	-1,69%	0,70%	-4,30%	0,06%	1,57%	5,18%	-1,84%	-8,08%	-2,05%	-1,08%	-17,78%
2019	-3,88%	1,08%	2,42%	1,88%	-7,44%	4,16%	3,70%	0,58%	-13,98%	-6,56%	-0,04%	-0,76%	-18,72%
2020	1,60%	-7,67%	10,68%	-1,31%	-1,25%	-3,26%	5,01%	-2,33%	-3,66%	5,99%	-0,54%	9,89%	12,05%
2021	-0,49%	4,69%	-0,37%	8,44%	3,66%	0,22%	7,71%	4,03%	0,37%	10,28%	-3,43%	-0,43%	39,43%
2022	-2,61%	0,26%	12,16%	6,00%	-2,78%	4,29%	-3,25%	5,29%	1,30%	1,63%	-7,25%	-2,98%	11,08%
2023	-1,13%	-0,25%	-1,81%	9,33%	4,00%	3,43%	-0,38%	-0,70%	-0,02%	-2,70%	-0,07%	-1,96%	7,36%
2024	1,53%	3,70%	3,15%	-3,57%	-0,08%	-1,44%	-4,68%	-6,97%	1,01%	-4,17%	-0,96%	-1,34%	-13,50%
2025	0,61%	-5,75%											-5,17%

FONDSDATEN

AIFM:	smn INVESTMENT SERVICES GMBH	Öffentlicher Vertrieb:	AT, LU
Depotbank:	CACEIS Bank Luxembourg Branch	Steuerlich vertreten:	AT, LU
Wirtschaftsprüfer:	Deloitte S.A., Luxemburg	Minimum Investment:	EUR 100,-
Start Fonds Anteilsklasse:	31.10.1996	ISIN:	LU0070804173
Fondswährung :	EURO	Bloomberg Ticker:	SMNDIVF LX
Fondstyp:	Alternative Investment Fund, Luxemburg SICAV	Zeichnung, Rücklösung:	wöchentlich + Monatsultimo

WICHTIGER HINWEIS

Diese Marketingmitteilung dient zu Informationszwecken und stellt keine Anlageberatung, Anlageempfehlung oder Finanzanalyse dar. Es ist weder ein Angebot noch eine Aufforderung zur Abgabe eines Angebots zum Abschluss eines Vertrages über eine Wertpapierdienstleistung oder Nebendienstleistung. Dieses Dokument kann eine Beratung durch Ihren persönlichen Anlageberater, Rechtsanwalt und Steuerberater nicht ersetzen. Detaillierte Beschreibungen zu Kosten, Gebühren, Hebel, Risiken, aktuellen Anteilspreis sowie weitere wichtige Informationen, entnehmen Sie bitte dem jeweiligen Verkaufsprospekt inkl. Informationen gem. § 21 AIFMG, Jahres- und ggf. Halbjahresbericht, sowie den wesentlichen Anlegerinformationen (KID). Die Dokumente sind kostenlos in deutscher und englischer Sprache bei smn INVESTMENT SERVICES GMBH, Rotenturmstr. 16-18, 1010 Wien und unter www.smn.at erhältlich. Finanzinstrumente unterliegen u.a. Kurs-, Zins- und Währungsrisiken sowie Schwankungen, aufgrund derer die Rendite steigen oder fallen kann und es zum Verlust bis hin zum Totalverlust des Investments kommen kann. Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten. smn übernimmt keine Garantie für die Aktualität, Richtigkeit und Vollständigkeit der in diesem Dokument enthaltenen Informationen. Jegliche Haftung für Anlageverluste und sonstige Schäden aus Anlageentscheidungen auf Basis dieser Informationen wird ausgeschlossen.

Hinweise auf den Vertrieb in der Schweiz

Heimatstaat der kollektiven Kapitalanlage:

Schweizer Vertreter:

Swiss paying agent:

Luxemburg
 ACOLIN Fund Services AG
 Leutschenbachstrasse 50, 8050 Zürich, Schweiz
 Caceis Bank, Switzerland Branch
 succursale de Nyon, Route de Signy 35, CH-1260 Nyon

Fondsdokumente (Prospekt sowie der Jahres- und Halbjahresbericht, sofern dieser jüngeren Datums als der Jahresbericht ist) können kostenlos beim Vertreter des Fonds in der Schweiz bezogen werden.



Quelle: Bloomberg, smn INVESTMENT SERVICES GMBH
 Erstelldatum und Informationsstand: 04.03.2025