

# Managed Futures Anleihe



## Monatlicher Performancebericht per 30. November 2017

Letzter Monat : -0,07 % Seit Jahresbeginn : -2,33 %

### Fond Details

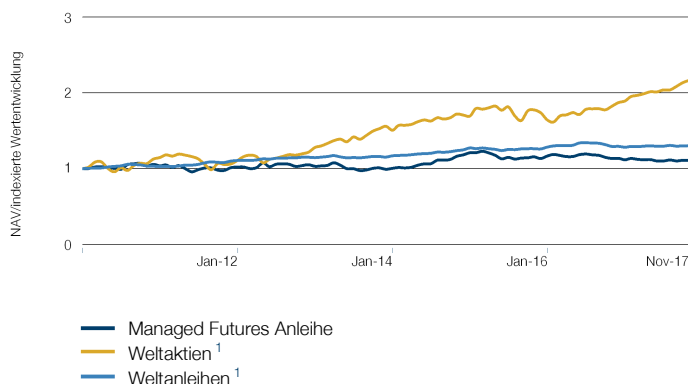
Auflegungsdatum	1 Februar 2010
Fondsvolumen (Anteilsklasse)	9.103.930
Anzahl der Anteile	8.201.000
NAV pro Anteil	(EUR) 1,1101
Währung	EUR
Investment Manager	Man Investments Limited

ISIN	DE000LBW64A0
Bloomberg-Ticker	LBW64A
Valoren	10571154
Reuters Seite	DE000LBW64A0=LBBW
Laufzeitende	30-Jun-2024
Administrator und Depotbank	Citi Hedge Fund Services, Ltd.

### Performance Statistik

	Produkt	Weltaktien <sup>1</sup>	Weltanleihen <sup>1</sup>
Letzter Monat	-0,07 %	1,41 %	0,10 %
Letztes Quartal	-0,44 %	6,20 %	-0,37 %
Seit Jahresbeginn	-2,33 %	15,71 %	0,62 %
Letzten 12 Monate	-2,12 %	18,78 %	0,72 %
Letztes Kalenderjahr	0,26 %	7,79 %	2,70 %
Gesamtrendite <sup>2</sup>	11,01 %	116,63 %	30,25 %
Annualisierte Rendite <sup>2</sup>	1,34 %	10,37 %	3,43 %
Annualisierte Volatilität <sup>2</sup>	7,52 %	11,18 %	2,86 %
Anteil der positiven Monate <sup>2</sup>	57,45 %	67,02 %	63,83 %
Sharpe Ratio <sup>3</sup>	0,14	0,90	1,10
Worst Drawdown	-10,48 %	-17,29 %	-4,45 %
Korrelation		-0,03	0,71

### Performance Chart



### Historische Performance

Jahr	Jan	Feb	Mrz	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sept	Okt	Nov	Dez	YTD	Weltaktien <sup>1</sup>	Weltanleihen <sup>1</sup>
2010		0,13 %	2,11 %	0,25 %	-1,10 %	-0,95 %	-1,31 %	6,26 %	1,04 %	0,59 %	-3,43 %	2,24 %	5,67 %	12,63 %	3,20 %
2011	-1,85 %	1,11 %	-3,11 %	2,42 %	-4,04 %	-4,04 %	3,06 %	2,13 %	0,11 %	-3,01 %	-0,28 %	3,73 %	-4,14 %	-5,70 %	6,60 %
2012	0,73 %	0,16 %	-2,08 %	1,26 %	6,19 %	-4,62 %	3,14 %	0,54 %	-0,53 %	-2,71 %	0,93 %	1,24 %	3,89 %	14,63 %	4,62 %
2013	-2,05 %	0,51 %	0,74 %	3,26 %	-3,06 %	-4,32 %	0,00 %	-2,52 %	0,88 %	2,16 %	0,60 %	-1,81 %	-5,74 %	28,07 %	0,17 %
2014	1,25 %	1,05 %	-0,54 %	0,85 %	2,75 %	1,65 %	0,20 %	4,41 %	-0,05 %	0,92 %	3,69 %	1,65 %	19,21 %	9,48 %	8,30 %
2015	2,37 %	-0,01 %	1,58 %	-1,78 %	-2,64 %	-4,00 %	1,83 %	-1,97 %	1,14 %	0,36 %	1,05 %	-1,91 %	-4,14 %	1,74 %	0,95 %
2016	2,97 %	1,74 %	-1,12 %	-1,28 %	0,13 %	2,08 %	0,72 %	-0,97 %	-0,51 %	-2,29 %	-1,30 %	0,22 %	0,26 %	7,79 %	2,70 %
2017	-1,71 %	1,58 %	-1,02 %	-0,53 %	0,20 %	-1,62 %	-0,06 %	1,30 %	-1,19 %	0,84 %	-0,07 %		-2,33 %	15,71 %	0,62 %

# Managed Futures Anleihe



## Strategie Aufschlüsselung<sup>4</sup>

Strategie	Allokation	Rendite	Attribution
Global Macro(GM)	26,2 %	0,3 %	0,08 %
Managed Futures	26,2 %	0,3 %	0,08 %
Relative value(RV)	1,0 %	-1,3 %	-0,01 %
Statistical Arbitrage	1,0 %	-1,3 %	-0,01 %

## Top 10 Manager Allokation und Attribution<sup>5</sup>

Manager	Strategie	Allokation	Rendite	Attribution
Blakeney Fund Limited	GM	4,51 %	1,00 %	0,02 %
Quantica MF Cayman Fund Ltd	GM	3,72 %	3,69 %	0,08 %
Campbell MAC Cayman Fund Ltd	GM	2,88 %	-0,22 %	0,00 %
AHL Institutional Series 1 LTD	GM	2,59 %	0,00 %	-0,01 %
Silver MAC Limited	GM	2,43 %	0,72 %	0,01 %
Century CAT MAC Cayman	GM	2,24 %	3,98 %	0,08 %
AHL (Cayman) SPC - Class A1 Evolution	GM	2,17 %	0,71 %	0,02 %
Graham TTCB MAC Cayman Fund Limited	GM	1,81 %	0,00 %	-0,03 %
Century City Ireland Fund PLC	GM	1,47 %	-5,14 %	-0,06 %
Man AHL Evolution Frontier Limited	GM	1,23 %	-0,70 %	-0,01 %
Gesamt		25,05 %		

# Managed Futures Anleihe



## Wichtige Anmerkungen

- <sup>1</sup> Weltaktien: MSCI World Net Total Return Index hedged to EUR. Weltanleihen: Citigroup World Government Bond Index hedged to EUR (Total return). Diese Indizes sind keine Benchmarks, da sie für die Anlagestrategie des Fonds nicht repräsentativ sind. Sie dienen lediglich dazu, unterschiedliche Anlagekategorien miteinander zu vergleichen.
- <sup>2</sup> Seit Auflegung des Produkts.
- <sup>3</sup> Risikofreier Zinssatz: 0,22% (durchschnittlicher 1-Monats-LIBOR).
- <sup>4</sup> Die Informationen über Strategieallokationen und Renditebeiträge beziehen sich auf die auf Master-Fund-Ebene gehaltenen Portfolioanlagen.
- <sup>5</sup> In der gezeigten Positionenliste sind ausschliesslich Anlagen des Master Fund aufgeführt. Die Allokation in % basiert auf dem Gesamtnettoinventarwert des Master Fund. Bei Portfolios mit mehr als einem Fonds oder einer Anteilsklasse kann der Manager die bereitgestellten Daten entsprechend zusammenfassen. Gewisse Angaben, die eine Identifizierung ermöglichen, können aus Vertraulichkeitsgründen zurückgehalten werden.

Sofern nicht anders vermerkt, stammen alle Informationen per 1. Dez. 2014 von der Man Group plc und ihren verbundenen Unternehmen. Sofern nicht anders vermerkt, stammen alle Marktdaten von Bloomberg.

Der Wert einer Anlage und die Einkünfte davon können sinken oder steigen, weshalb die Anleger den ursprünglich investierten Betrag möglicherweise nicht zurückerhalten. Alternative Anlagen bergen unter Umständen erhebliche zusätzliche Risiken. Dieses Informationsmaterial dient ausschliesslich Informationszwecken und stellt weder ein Angebot noch eine Aufforderung dar, in ein Produkt zu investieren, für das ein assoziiertes Unternehmen der Man Group plc Beratungsdienste oder andere Dienstleistungen erbringt. Der Inhalt ist nicht als Beratung, Anlageempfehlung oder Meinung bezüglich der Eignung oder Angemessenheit einer Anlage oder Anlagestrategie zu verstehen und trägt den spezifischen Umständen der einzelnen Empfänger dieses Informationsmaterials nicht Rechnung. Dieses Informationsmaterial richtet sich nicht an Personen aus und/oder in den USA.

In bestimmten Jurisdiktionen können die Verbreitung des vorliegenden Informationsmaterials und das Angebot der Aktien Beschränkungen unterliegen und der Mindestzeichnungsbetrag kann höher sein als andernorts. Das/Die in diesem Informationsmaterial genannte(n) Produkt(e) (i) ist/sind möglicherweise in Ihrer Jurisdiktion nicht registriert und (ii) steht/stehen unter Umständen nur professionellen oder anderweitig qualifizierten Investoren oder juristischen Personen offen. Vertriebsträger und/oder potenzielle Anleger müssen vor einer Zeichnung sicherstellen, dass sie die lokalen Bestimmungen einhalten können. Weitere Informationen sind im Emissionsprospekt enthalten.

Dieses Informationsmaterial ist urheberrechtlich geschützt und darf ohne die vorherige schriftliche Genehmigung weder vollständig noch teilweise reproduziert oder weitergegeben werden. Die Datendienste und Informationen aus öffentlichen Quellen, auf die bei der Erstellung dieses Informationsmaterials zurückgegriffen wurde, werden als zuverlässig eingestuft. Für die Richtigkeit dieser Informationen wird jedoch keine Gewähr übernommen. © Man 2014

Dieses Informationsmaterial wurde von FRM Investment Management Limited (die von der Guernsey Financial Services Commission lizenziert wurde und unter deren Aufsicht steht) erstellt und unter weltweiten Vertriebsvereinbarungen durch Tochtergesellschaften der Man Group plc insbesondere in folgenden Jurisdiktionen vertrieben:

**Australien:** In Australien wird dieses Informationsmaterial durch Man Investments Australia Limited ABN 47 002 747 480 AFSL 240581 vertrieben, einem Unternehmen, das der Aufsicht der Australian Securities & Investments Commission (ASIC) untersteht. Diese Informationen wurden ohne Berücksichtigung der Ziele, der finanziellen Lage oder des Bedarfs irgendeiner Person erstellt.

**Europäische Union:** Sofern nicht anders vermerkt, wird dieses Informationsmaterial in der Europäischen Union von GLG Partners LP herausgegeben, einem Unternehmen, das der Aufsicht der britischen Financial Conduct Authority untersteht.

**Deutschland/Liechtenstein:** In Deutschland und/oder Liechtenstein wird dieses Informationsmaterial von der Man (Europe) AG herausgegeben, die durch die Finanzmarktaufsicht (FMA) Liechtenstein zugelassen wurde und beaufsichtigt wird. Die Man (Europe) AG ist im Fürstentum Liechtenstein unter der Nr. FL-0002.420.371-2 registriert. Sie ist ein assoziierter Teilnehmer des Anlegerentschädigungsprogramms, das von der Einlagensicherungs- und Anlegerentschädigungs-Stiftung SV (FL-0002.039.614-1) betrieben wird und EU-Recht entspricht. Nähere Informationen sind auf der Website der Stiftung unter [www.eas-liechtenstein.li](http://www.eas-liechtenstein.li) erhältlich. Dieses Informationsmaterial hat Werbecharakter.

**Hongkong:** In Hongkong wird dieses Informationsmaterial, das nicht von der Securities and Futures Commission in Hongkong überprüft wurde, von Man Investments (Hong Kong) Ltd herausgegeben. Dieses Informationsmaterial darf ausschliesslich an Intermediäre und professionelle Kunden kommuniziert werden, die zu den in der Securities and Futures Ordinance aufgeführten Ausnahmen für professionelle Anleger gehören, und ist für andere Personen ungeeignet.

**Singapur:** In Singapur wird dieses Material lediglich zu Informationszwecken herausgegeben, und es handelt sich weder um eine Anlageempfehlung noch um Researchmaterial. Dieses Informationsmaterial wird ausschliesslich an (i) institutionelle Anleger (gemäss Definition in Section 4A des Securities and Futures Act, Chapter 289 ("SFA")) gemäss Section 304 des SFA oder (ii) ansonsten gemäss und in Übereinstimmung mit den Bestimmungen jeder anderen anwendbaren Vorschrift des SFA verteilt und ist für andere Personen ungeeignet.

**Schweiz:** Herausgeber dieses Informationsmaterials in der Schweiz ist die Man Investments AG, die der Aufsicht der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA untersteht. Der Fonds ist nicht zum Vertrieb in der Schweiz zugelassen. Der Fonds und die Informationsmaterialien des Fonds dürfen nur an qualifizierte Anleger gemäss Artikel 10 des Bundesgesetzes über die kollektiven Kapitalanlagen vertrieben werden. Empfängern dieses Informationsmaterials wird empfohlen, sich mit den regulatorischen Bestimmungen vertraut zu machen. Bitte beachten Sie, dass Sie dieses Informationsmaterial nur weitergeben dürfen, wenn Sie über eine Bewilligung als Vertriebsträger verfügen (bzw. gemäss Artikel 8 der Kollektivanlagenverordnung von der Bewilligungspflicht befreit sind) und mit der Man Investments AG eine schriftliche Vertriebsvereinbarung getroffen haben.

