



Beleggingsbeleid

De strategie is gebaseerd op een combinatie van passieve indexfondsen (markt) en factorfondsen. In het factordeel worden de vijf factoren waarde, kwaliteit, omvang, lage volatiliteit en momentum gelijk gewogen opgenomen. De portefeuille wordt met enige regelmaat geherbalanceerd op de oorspronkelijk strategische gewichten. Bij de invulling gaat de voorkeur uit naar indexfondsen die tegen zo laag mogelijke kosten invulling kunnen geven aan deze strategie. Het aantal transacties in deze portefeuille is normaal gesproken beperkt.

Rendement en statistieken

31-10-2023	maand	3 mnd	2023	12 mnd
Auréus Inv. Market Factor	-3,2%	-5,5%	3,2%	-1,1%
Spyder ACWI IMI Etf*	-3,9%	-6,3%	6,2%	2,3%

*IE00B3YLTY66

31-10-2023	1 jaar	3 jaar	5 jaar
Gem. jaarlijks rendement fonds	-1,1%	n.v.t.	n.v.t.
Gem. jaarlijks rendement benchmark	2,3%	n.v.t.	n.v.t.
Tracking error	n.v.t.	n.v.t.	n.v.t.
Outperformance	n.v.t.	n.v.t.	n.v.t.
Ex-post tracking error	n.v.t.	n.v.t.	n.v.t.
Information ratio	n.v.t.	n.v.t.	n.v.t.

* Startdatum Auréus Investments Market Factor A 29-03-2021.

Geen data bij historie korter dan één jaar.

Top 5 sectoren		Regioverdeling	
Information Technology	21,3%	Noord-Amerika	59,1%
Financial Services	14,3%	Europa	20,2%
Healthcare	13,1%	Azië	15,4%
Industrial	12,3%	Opkomende markten	7,5%
Consumer Cyclical	11,2%	Overig	-2,2%

Fondsnaam

Auréus Investments Market Factor A

Juridische structuur	SICAV
ICBE (UCITS)	Ja
Basisvaluta	euro
Fondsbeheerder	VP Fund Solutions S.A.
Portefeuillebeheerder	Auréus Group B.V.
Bewaarder	VP Bank Luxembourg
Accountant	PWC Luxembourg

Dividuitkerend

Nee

Categorie

wereldwijd aandelen

Benchmark

SPDR ACWI IMI Etf

NAV

9,67

Fondsomvang

€ 32,4 miljoen

Aantal posities

9

Valuta

euro

ISIN

LU2265364187

Einde boekjaar

31-dec

Startdatum

29-mrt-21

WKN

A2QKTK

Securities Number

58758800

Bloomberg Ticker

AUIMFAE LX

Registratie

LU,NL

Top 9 posities

xTrackers Wrld Quality	12,1%
xTrackers Wrld Value	11,9%
ishares MSCI Acwi	11,7%
Actiam Duurza Ind aand	11,5%
Vanguard FTSE All-worlc	11,5%
iShares Edge Momentu	11,2%
iShares MSCI Min Vol	11,1%
Vanguard GI Small Cap	10,5%
NT Em Custom ESGV	7,6%
Totaal top 9	99,1%

Maandupdate

In de afgelopen is opnieuw gebleken dat de markt/factor portefeuille minder risico neemt dan een gewone marktportefeuille. Zo daalde de marktcomponent (de index) met 3,5 procent en de vijf factoren met gemiddeld 2,6 procent. De factoren die beter presteerden dan dat gemiddelde waren achtereenvolgens Minimum Volatility, Value en Momentum. Elke factor heeft daarvoor een eigen verklaring. Min.vol-aandelen, zijn over het algemeen minder gevoelig voor marktbevingen, zowel omhoog als ook omlaag. De reden dat value beter presteerde dan de markt is vooral te verklaren door de draai van groei naar value, nadat eerder dit jaar met name groeiaandelen goed hebben gepresteerd. De outperformance van momentum is bijzonder, omdat normaal gesproken in een correctie momentum extra hard naar beneden gaat. De verklaring is dat deze index voor een deel nog bestaat uit aandelen die het vooral vorig jaar goed hebben gedaan en dat zijn dezelfde aandelen die ook in het derde kwartaal van 2023 relatief goed presteerden.

Kostenstructuur

Management	1,00%
Overige kosten	0,10%
Lopende kosten	1,10%

Enmalige kosten

Geen instapvergoeding
Geen uitstapvergoeding

Contactinformatie

Website	www.aureus.eu
Email	info@aureus.eu
Telefoon	020-5225252

ESG Scores

MSCI ESG Score	A
Morningstar	2 globes
ESG classificatie	art.6
CO2 portefeuille	126,2*
Benchmark	142,3*

* ton CO2/\$M omzet, bron: MSCI

DISCLAIMER

Auréus Investments SICAV is een ICBE (UCITS) die wordt beheerd door V.P. FundSolutions S.A. Auréus Group B.V. is als beleggingsonderneming geregistreerd bij de Autoriteit Financiële Markten. Voor dit product is een prospectus alsmede de Essentiële Beleggingsinformatie (EBI) opgesteld met informatie over het product, de kosten en de risico's. Het prospectus, de EBI alsmede overige informatie over het product zijn verkrijgbaar bij Auréus Group (Leidenlaan 16D, Maastricht) en via VP Bank Fund Solutions (www.vpfundsolutions.com) in Luxemburg.

De waarde van uw belegging kan fluctueren. In het verleden behaalde resultaten bieden geen garantie voor de toekomst.

Dit materiaal dient enkel ter informatie en kan niet worden gezien als een aanbod, aanbeveling of uitnodiging tot het aankopen, aanhouden of verkopen van financiële instrumenten zoals genoemd in dit document noch kan dit artikel worden beschouwd als (persoonlijk) beleggingsadvies. Auréus heeft alle redelijkerwijs mogelijke zorg besteed aan de juistheid van dit materiaal, echter aanvaardt geen aansprakelijkheid van welke aard ook met betrekking tot de juistheid, volledigheid van de hierin opgenomen informatie. De verstrekte portefeuilleposities zijn niet gecontroleerd door een externe accountant. De in dit materiaal opgenomen opinies kunnen worden gewijzigd zonder voorafgaand bericht. Auréus is niet verplicht de hierin opgenomen informatie en opinies te actualiseren of te wijzigen.