

Angebot für Modellportfolio **WACHSTUM (SRRI 5)**

Mustermann, Erika
Heidestr.7
51147 Köln
Deutschland

22.11.2023

Modellportfolio WACHSTUM (SRRI 5)

Beschreibung, Startdatum & Ziel-Risiko

Startdatum: 30.06.2019

Zielrisiko: offensiv (Risikoklasse 5)

Zielmarkt

Anlageziel: *Allgemeine Vermögensbildung / Vermögensoptimierung* - Zeithorizont: *länger als 5 Jahre (langfristig)* - Risikobereitschaft: *sehr hohe Risikobereitschaft (Risikoklasse 6)* - Verlusttoleranz: *Verluste bis zum eingesetzten Kapital* - Kenntnisniveau des Kunden: *Erweiterte Kenntnisse*

Benchmark

Name: 5% Zinsen

Zinssatz: 5,00 %

Anlagevolumen

Einmalanlage:

100.000,00 EUR

Geplante Depotbank:



Performance

Performance gemäß zeitgewichteter Rendite (BVI-Methode) im historischen Verlauf im Vergleich zum Benchmark des Modells.



■ Modellportfolio
■ Benchmark

Wertentwicklung

Simulierte Wertentwicklung wenn zum 30.06.2019 eine Einmalanlage von 100.000,00 EUR investiert worden wäre.

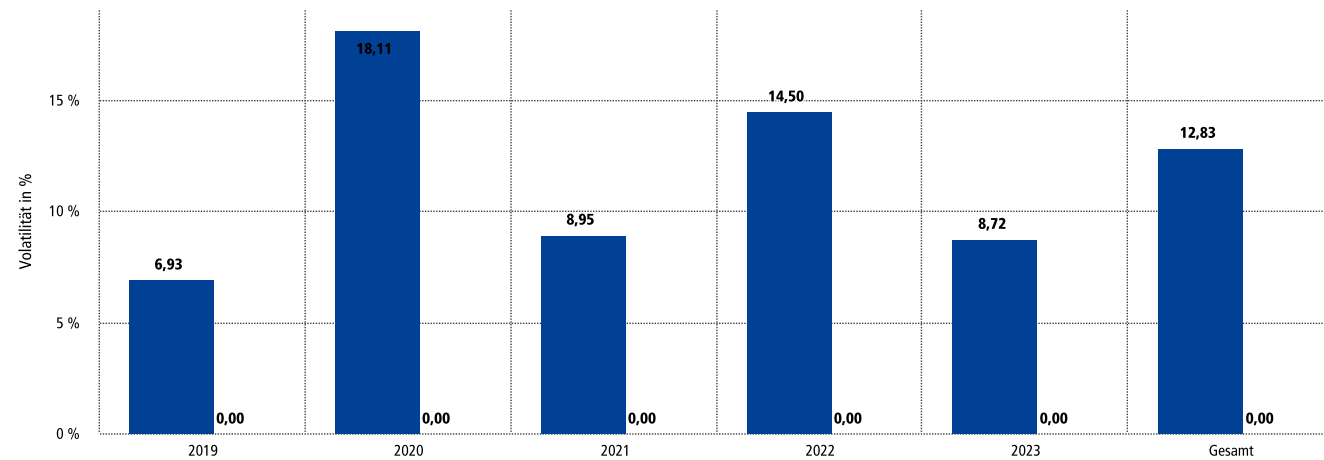
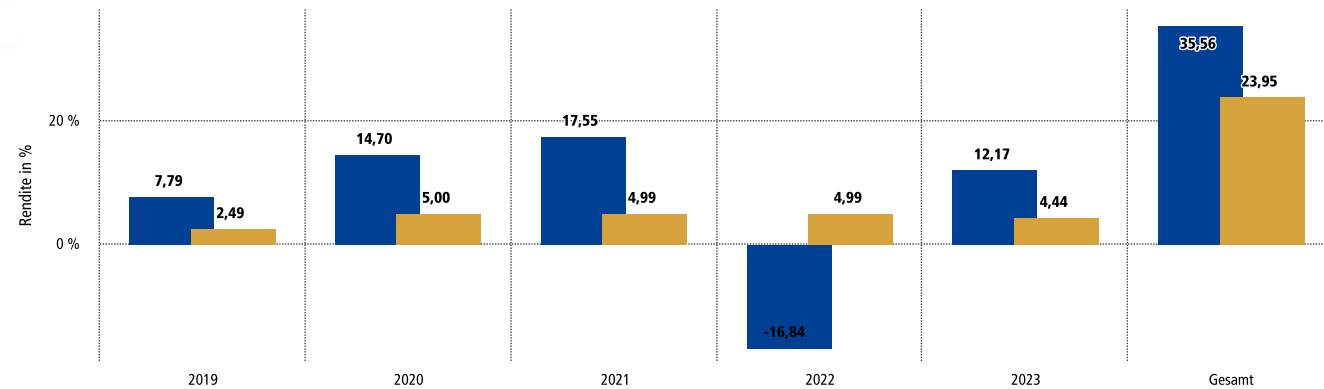
(* nach Fondskosten, vor Kosten: Beratung, Service, Steuer, Entgelte Depotstelle)



Annualisierte Rendite

Die annualisierte Rendite gibt an, wie hoch die Rendite des gewählten Modellportfolios in jedem betrachteten Kalenderjahr ausgefallen ist. Die Rendite in einzelnen Kalenderjahren kann signifikant von der Gesamtrendite des betrachteten Zeitraums abweichen. Dies hilft Ihnen einen Überblick zu gewinnen, wie konstant die Entwicklung eines Portfolios verlaufen ist.

Die zusätzlich ausgewiesene Volatilität gibt an wie stark die Kursschwankungen innerhalb des jeweiligen Kalenderjahres bzw. im Gesamtzeitraum waren. Dieser Wert wird auch als Risiko einer Geldanlage bezeichnet. Grundsätzlich kann davon ausgegangen werden, dass eine höhere Rendite auch mit einem höheren Risiko verbunden ist.



Anlagedetails

Produktname / ISIN	Kategorie	SRRI	Volatilität 1 Jahr	Volatilität 3 Jahre	Fondsvol. in Mio.	Ertragsverwendung	Anteil	Anlagebetrag
AB SICAV I - American Growth Portfolio A EUR LU0232524495	Aktienfonds	6	14.03	17.94	6.448,64	thesaurierend	10,00 %	10.000,00 EUR
ACATIS VALUE EVENT FONDS C DE000A1T73W9	Mischfonds	5	10.08	10.34	7.262,02	ausschüttend	5,00 %	5.000,00 EUR
Amundi BB Equal-weight Commodity ex-Agricu. UCITS ETF A LU1829218749	Rohstofffonds	6	12.76	17.01	1.663,61	thesaurierend	5,00 %	5.000,00 EUR
AMUNDI MSCI WORLD UCITS ETF - EUR (C) LU1681043599	Aktienfonds	6	11.82	14.72	2.616,99	thesaurierend	10,00 %	10.000,00 EUR
HANSAGold EUR-Klasse F hedgeg DE000A2H68K7	Rohstofffonds	5	15.38	13.78	375,76	thesaurierend	5,00 %	5.000,00 EUR
iShares Dow Jones Global Titans 50 UCITS ETF (DE) DE0006289382	Aktienfonds	6	15.38	16.68	1.208,21	ausschüttend	10,00 %	10.000,00 EUR
Morgan Stanley INVF Global Opportunity Fund (EUR) AH LU0552385618	Aktienfonds	6	21.18	23.74	10.800,00	thesaurierend	7,50 %	7.500,00 EUR
Phaidros Funds - Balanced D LU0759896797	Mischfonds	5	7.41	9.86	1.371,76	ausschüttend	5,00 %	5.000,00 EUR

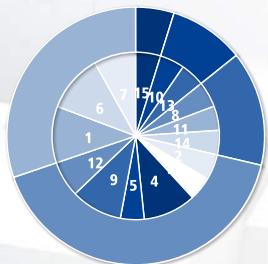
Anlagedetails

Produktname / ISIN	Kategorie	SRRI	Volatilität 1 Jahr	Volatilität 3 Jahre	Fondsvol. in Mio.	Ertragsverwendung	Anteil	Anlagebetrag
Schroder ISF Global Sustainable Growth C Acc LU0557290854	Aktienfonds	6	13.59	16.77	4.887,55	thesaurierend	10,00 %	10.000,00 EUR
SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF IE00B41RYL63	Rentenfonds	3	6.38	6.47	531,44	ausschüttend	5,00 %	5.000,00 EUR
SQUAD Aguja Opportunities R DE000A2AR9B1	Mischfonds	4	7.86	10.82	268,14	ausschüttend	5,00 %	5.000,00 EUR
Threadneedle (Lux) European Smaller Companies 1E LU1864952335	Aktienfonds	6	14.19	19.26	1.334,70	thesaurierend	7,50 %	7.500,00 EUR
Vanguard Global Aggregate Bond UCITS ETF EUR Hedged Acc. IE00BG47KH54	Rentenfonds	3	5.93	5.61	2.826,00	thesaurierend	5,00 %	5.000,00 EUR
Vanguard USD Corporate Bond UCITS ETF USD Acc IE00BGYWFK87	Rentenfonds	4	8.61	7.84	1.458,00	thesaurierend	5,00 %	5.000,00 EUR
Xtrackers II EUR Overnight Rate Swap UCITS ETF 1C LU0290358497	Geldmarktfonds	1	0.26	0.49	3.787,33	thesaurierend	5,00 %	5.000,00 EUR

Summe 100.000,00 EUR

Portfolioaufteilung

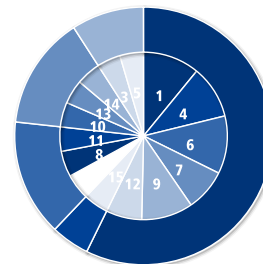
Risikoklasse



Legende

SRI 1	4,82 %
SRI 2	9,43 %
SRI 3	14,40 %
SRI 4	41,14 %
SRI 5	30,20 %

Kategorie



Legende

Aktienfonds	57,28 %
Geldmarktfonds	4,82 %
Mischfonds	14,63 %
Rentenfonds	14,16 %
Rohstofffonds	9,10 %

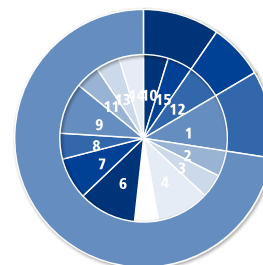
Anlageschwerpunkt



Legende

Aktienfonds All Cap	28,27 %
Aktienfonds Large Cap	22,09 %
Aktienfonds Small & Mid Cap	6,91 %
Geldmarktfonds allgemein	4,82 %
Mischfonds ausgewogen	9,93 %
Mischfonds flexibel	4,70 %
Rentenfonds Unternehmensanleihen Investment Grade	4,73 %
Rentenfonds allgemein gemischte Laufzeiten	4,78 %
Rentenfonds gemischt Investment Grade	4,66 %
Rohstofffonds Edelmetalle Gold	4,56 %
Rohstofffonds gemischt	4,54 %

Schwerpunktregion



Legende

Euroland	9,60 %
Europa (ex UK)	6,91 %
USA	10,93 %
Welt	72,55 %

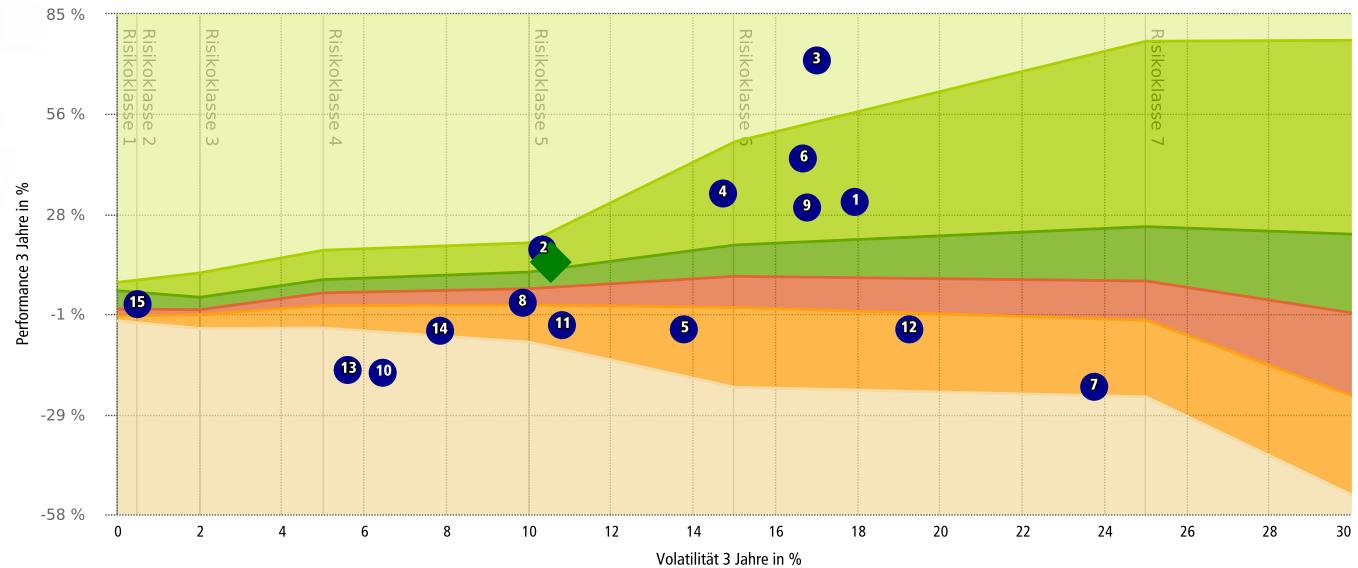
Fondsname

1 AB SICAV I - American Growth Portfolio A EUR	6 iShares Dow Jones Global Titans 50 UCITS ETF ...	11 SQUAD Aguja Opportunities R
2 ACATIS VALUE EVENT FONDS C	7 Morgan Stanley INVF Global Opportunity Fund ...	12 Threadneedle (Lux) European Smaller ...
3 Amundi BB Equal-weight Commodity ex-Agricu. ...	8 Phaidros Funds - Balanced D	13 Vanguard Global Aggregate Bond UCITS ETF EUR ...
4 AMUNDI MSCI WORLD UCITS ETF - EUR (C)	9 Schroder ISF Global Sustainable Growth C Acc	14 Vanguard USD Corporate Bond UCITS ETF USD Acc
5 H.S.N.T. World EUR-Klasse F hedgeg	10 SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF	15 Xtrackers II EUR Overnight Rate Swap UCITS ...

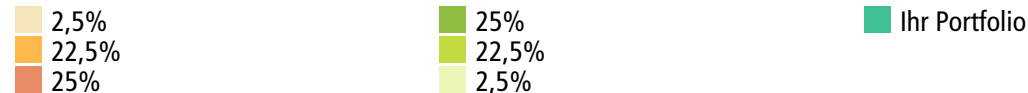
Risiko-Rendite-Korridor

Dem Diagramm können Sie die Risiko-/ Ertragseigenschaften der im Modellportfolio enthaltenen Produkte über die vergangenen drei Jahre entnehmen. Auf der senkrechten Achse wird die historische Wertentwicklung abgetragen, auf der waagrechten Achse die Volatilität, als Maß für das Risiko. Die Namen der Produkte können Sie der untenstehenden Tabelle entnehmen. Die Raute symbolisiert das Portfolio.

Der Grafik können Sie auch entnehmen, wie sich die Produkte im Vergleich zu allen anderen in Deutschland zum Vertrieb zugelassenen Fonds darstellen. So stellt zum Beispiel der obere Rand der grünen Fläche die Fonds mit der höchsten Wertentwicklung der jeweiligen Risikoklasse dar, die mittlere Linie gibt den Durchschnitt aller Fonds an, und die untere Begrenzung der roten Fläche markiert die schlechtesten Fonds der jeweiligen Risikoklasse.



Anteile der Fonds in Performance-Klassen



Fondsname

- | | | |
|--|---|--|
| 1 AB SICAV I - American Growth Portfolio A EUR | 6 iShares Dow Jones Global Titans 50 UCITS ETF ... | 11 SQUAD Aguja Opportunities R |
| 2 ACATIS VALUE EVENT FONDS C | 7 Morgan Stanley INVf Global Opportunity Fund ... | 12 Threadneedle (Lux) European Smaller ... |
| 3 Amundi BB Equal-weight Commodity ex-Agricu. ... | 8 Phaidros Funds - Balanced D | 13 Vanguard Global Aggregate Bond UCITS ETF EUR ... |
| 4 AMUNDI MSCI WORLD UCITS ETF - EUR (C) | 9 Schroder ISF Global Sustainable Growth C Acc | 14 Vanguard USD Corporate Bond UCITS ETF USD Acc |
| 5 HANSAgold EUR-Klasse F hedged | 10 SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF | 15 Xtrackers II EUR Overnight Rate Swap UCITS ... |

Spiderweb-/ Vergleichsdiagramm

In der rechtsstehenden Spider Web-Grafik haben wir einige der wichtigsten Portfolio-Kennzahlen für Sie zusammengefasst.

Diversification Ratio: Hier finden Sie die Gegenüberstellung der Diversification Ratio beider Portfolios. Je höher die Diversification Ratio ist, desto besser ist Ihr Portfolio diversifiziert und desto robuster sollte es auf Marktveränderungen reagieren.

Maximum Drawdown: Der Maximum Drawdown gibt an, wie hoch der maximale Verlust über einen Zeitraum von einem Jahr ausfallen könnte. Diesen Drawdown - das heißt diesen Verlust - sollten Sie unbedingt in der Lage sein zu verkraften. Es ist ein Verlust, der in einem normalen Kapitalmarktumfeld stets auftreten kann. Extrem-Situationen wie Terroranschläge, Naturkatastrophen oder extreme Situationen an Kapitalmärkten sind hier nicht berücksichtigt.

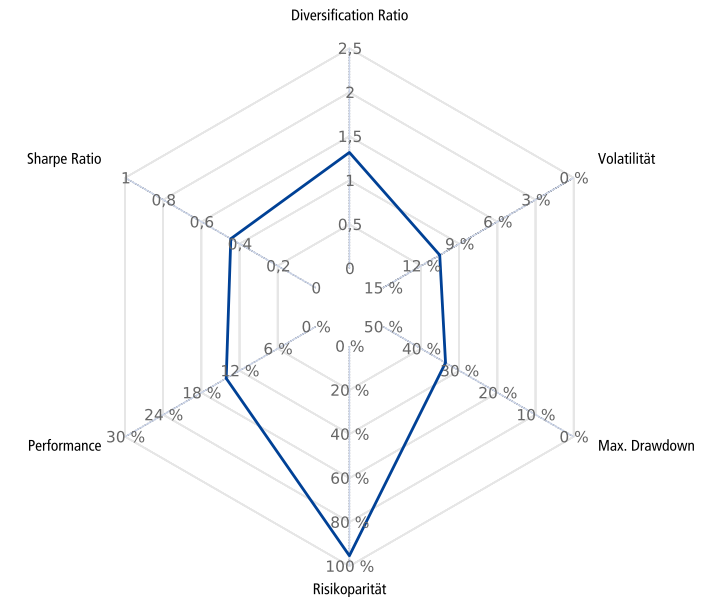
Performance: Hier werden die historische Wertentwicklung des optimierten und die des Benchmark-Portfolios miteinander verglichen. Betrachtungszeitraum sind die letzten drei Jahre. Bitte beachten Sie, dass die historische Wertentwicklung keine Prognose zur künftigen Wertentwicklung ist.

Volatilität: Je höher die Volatilität Ihres Portfolios, desto riskanter ist es und desto höher sind damit auch die Wahrscheinlichkeit und das mögliche Ausmaß eines Verlusts. Umgekehrt bedeutet eine hohe Volatilität aber auch die Möglichkeit, höhere Gewinne zu erzielen.

Bitte beachten Sie, dass die hier gemessene historische Volatilität keine Prognose für die Zukunft darstellt.

Risikoparität: Die Höhe der Risikoparität zeigt, wie gut die Einzelrisiken in Ihrem Portfolio verteilt sind. So bedeutet eine Risikoparität von 100%, dass alle Fonds in gleichem Maße zum Risiko des Gesamtportfolios beitragen. Das Gesamtportfolio ist damit nicht mehr abhängig von der Entwicklung einzelner Fonds, vielmehr wird das Risiko gleichmäßig auf mehrere „Schultern“ verteilt.

Sharpe Ratio: Je höher die Sharpe Ratio, desto höher die risikobereinigte Rendite des Portfolios. Im Gegensatz zur reinen Performance-Betrachtung berücksichtigt die Sharpe Ratio, wie viel Risiko zur Erzielung dieser Performance eingegangen wurde. Vergleicht man zwei Portfolios mit identischer Performance, wobei eines der beiden Portfolios ein deutlich geringeres Risiko eingegangen wäre, hätte das weniger riskante Portfolio eine höhere Sharpe Ratio. Die Sharpe Ratio bündelt also die Größen Risiko und Performance in einer Kennziffer.

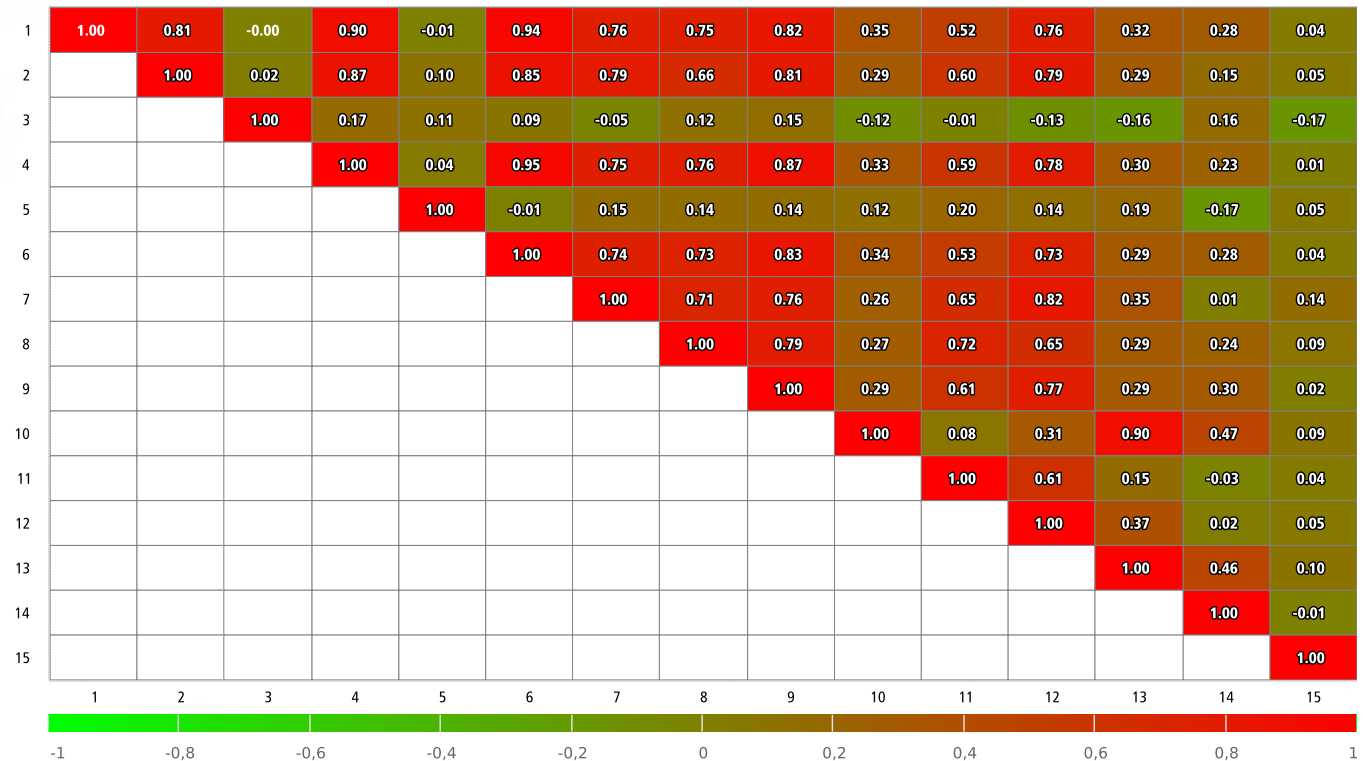


■ Ihr Portfolio

Korrelationsmatrix

Die folgende Matrix enthält die Korrelation der Anlagen untereinander. Die einzelnen Werte der Matrix geben den Korrelationskoeffizienten zweier Produkte an. Die Matrix ist wie folgt zu lesen: Wenn Sie die Korrelation zweier Produkte interessiert, entnehmen Sie deren Nummern aus der untenstehenden Tabelle (zum Beispiel die Produkte mit den Nummern 2 und 6). Sie gehen nun in der zweiten Zeile (da Produkt Nummer 2) bis zur sechsten Spalte (da Produkt Nummer 6). Dort finden Sie den Korrelationskoeffizienten der beiden Produkte, berechnet über die letzten drei Jahre.

Der Korrelationskoeffizient reicht von minus 1 bis plus 1. Je geringer der Korrelationskoeffizient ist, desto mehr Diversifikationspotenzial lässt sich erschließen (hier durch grünliche Farbtöne symbolisiert). Je näher der Koeffizient sich der 1 nähert, desto geringer fällt das Diversifikationspotenzial aus (hier durch rote Farbtöne dargestellt). Ziel des Diversifikationsansatzes ist es, möglichst schwach korrelierte Anlagen in einem Portfolio zu kombinieren.



Fondsname

- 1 AB SICAV I - American Growth Portfolio A EUR
- 2 ACATIS VALUE EVENT FONDS C
- 3 Amundi BB Equal-weight Commodity ex-Agricu. ...
- 4 AMUNDI MSCI WORLD UCITS ETF - EUR (C)
- 5 HANSAGold EUR-Klasse F hedgeg

- 6 iShares Dow Jones Global Titans 50 UCITS ETF ...
- 7 Morgan Stanley INVf Global Opportunity Fund ...
- 8 Phaidros Funds - Balanced D
- 9 Schroder ISF Global Sustainable Growth C Acc
- 10 SPDR Bloomberg Euro Aggregate Bond UCITS ETF

- 11 SQUAD Aguja Opportunities R
- 12 Threadneedle (Lux) European Smaller ...
- 13 Vanguard Global Aggregate Bond UCITS ETF EUR ...
- 14 Vanguard USD Corporate Bond UCITS ETF USD Acc
- 15 Xtrackers II EUR Overnight Rate Swap UCITS ...

Mögliche Portfolioentwicklung

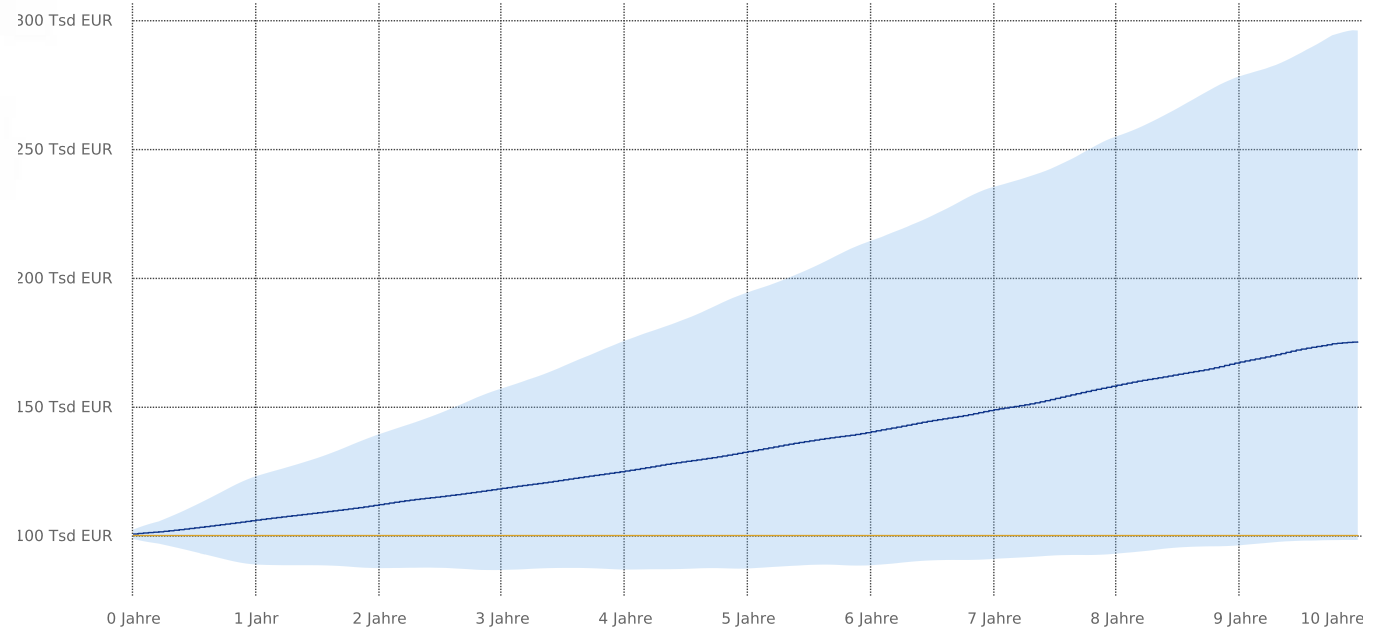
Grundlage ist die wahrscheinlichkeitsbasierten Simulation der Wertentwicklung innerhalb der gewählten Risikoklassen (Value-at-Risk)

Renditeerwartungen

Folgende Renditeerwartungen liegen der Simulation der möglichen Portfolioentwicklung zugrunde:

- Risikoklasse 1: 1,06 %
- Risikoklasse 2: 2,38 %
- Risikoklasse 3: 3,07 %
- Risikoklasse 4: 4,42 %
- Risikoklasse 5: 4,43 %
- Risikoklasse 6: 4,43 %
- Risikoklasse 7: 4,43 %

Die erwarteten Renditen der verschiedenen Risikoklassen ergeben sich aus dem Mittel aller zu einer Risikoklasse gehörenden offenen Investmentfonds, für die eine mindestens fünfzehnjährige Kursreihe verfügbar ist.



- Korridor der 90%-Wahrscheinlichkeit der Wertentwicklung
- Durchschnittliche Portfolioentwicklung
- Kapitaleinsatz

Haftungsausschluss

Diese Anwendung wird mit größter Sorgfalt bereitgestellt und betrieben. Die Bereitstellung und der Betrieb der Anwendung erfolgen als reine Gefälligkeit, ohne dass daraus irgendwelche vertraglichen Verpflichtungen für den Anbieter entstehen. Deshalb wird auch keine Garantie für die Vollständigkeit, die Aktualität, die Genauigkeit und die korrekte Reihenfolge der in dieser Anwendung dargestellten Informationen übernommen. Darüber hinaus kann es bei den ermittelten Informationen zu Auslassungen, Ungenauigkeiten oder Verzögerungen kommen. Mit der Nutzung dieser Anwendung erklären Sie sich einverstanden, dass der Anbieter keine Eventual- oder anderweitige Haftung für die Vollständigkeit, Aktualität, Genauigkeit und korrekte Reihenfolge der Informationen übernimmt und bei Entscheidungen oder Maßnahmen, die von Ihnen im Vertrauen auf diese Anwendung getroffen bzw. ergriffen wurden oder für Ausfälle bei Daten, Informationen oder anderen Aspekten dieser Seite bzw. Ausdrucken von Ergebnissen dieser Anwendung, auch nicht (vertraglich, durch Gefährdungshaftung oder anderweitig) für unmittelbare oder mittelbare Sonder-, Folge- oder Nebenschäden, Strafschadenersatz oder verschärften Schadenersatz haftbar gemacht werden kann. Es wird keine Zusicherung hinsichtlich der Eignung der Informationen (ob online oder als Ausdruck), Software, Produkte oder Dienste, die in dieser Anwendung enthalten sind, gemacht. Diese Informationen, Software, Produkte und Dienste werden ohne jedwede Garantien oder Gewährleistungen bereitgestellt. Änderungen der Produktspezifikationen sind ohne Vorankündigung vorbehalten.

Kontaktinformation

fondsfueralle.de; Eberhard, Martin

Prinz-Karl-Palais Schertlinstraße 23
86159 Augsburg

Email: [fueralle.de">team@fondsfueralle.de](mailto:team@fonds<span style=)

Telefon: 0821 450 40 540
Fax: 0821 450 405 41

Homepage: [fueralle.de">www.fondsfueralle.de](http://www.fonds<span style=)

Morningstar® Portfolio X-Ray : Modellportfolio – WACHSTUM (SRRI 5)

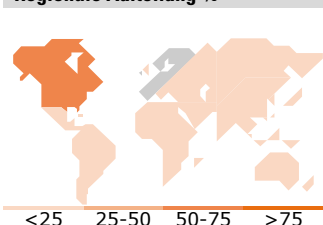
Vermögensaufteilung

	Long	Short	Net
● Aktien	65,61	0,00	65,61
● Anleihen	16,76	0,00	16,76
● Cash	3,21	0,78	2,43
● Sonstige	15,26	0,05	15,20
● Nicht klassifiziert	0,00	0,00	0,00

Top 10 Länder %

Land	Aktien	Land	Aktien
USA	58,84	Japan	2,93
Deutschland	4,45	Niederlande	2,38
Schweiz	4,28	Italien	2,23
Grossbritannien	4,24	Dänemark	2,03
Frankreich	3,59	Brasilien	1,45

Regionale Aufteilung %



Region	Aktien
Europa	29,38
Großbritannien	4,24
Euroland	16,44
Westeuropa ex Euro	8,41
Schwellenl. Europa	0,14
Afrika	0,15

Region	Aktien
Amerika	61,85
USA	58,84
Kanada	1,42
Lateinamerika	1,60

Region	Aktien
Asien	8,77
Japan	2,93
Australasien	0,65
4 Tiger	3,13
Asien ex- 4 Tiger	2,06

Aktien	0,00
Nicht klassifiziert	0,00

Aktiensektor %



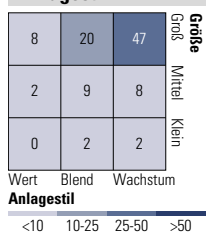
▲ Benchmark
● Portfolio

Sektor	Aktien
Zyklisch	29,17
Rohstoffe	2,33
Konsumgüter zyklisch	13,88
Finanzdienstleistungen	12,00
Immobilien	0,96

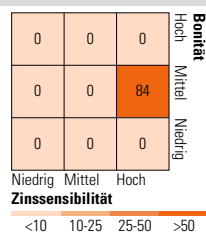
Sektor	Aktien
Sensibel	50,14
Telekommunikation	10,24
Energie	2,09
Industriewerte	9,36
Technologie	28,45

Sektor	Aktien
Defensiv	20,69
Konsumgüter n. zykl.	6,58
Gesundheitswesen	13,61
Versorger	0,50

Anlagestil



Anlagestil Aktien	Portfolio
Kurs/Buch	4,11
KGV	19,44
Kurs-Cashflow	13,88



Anlagestil Anleihen	Portfolio
Effektive Duration	5,92
Durchschn. Restlaufzeit	8,14
Durchschnittliche Bonität	A

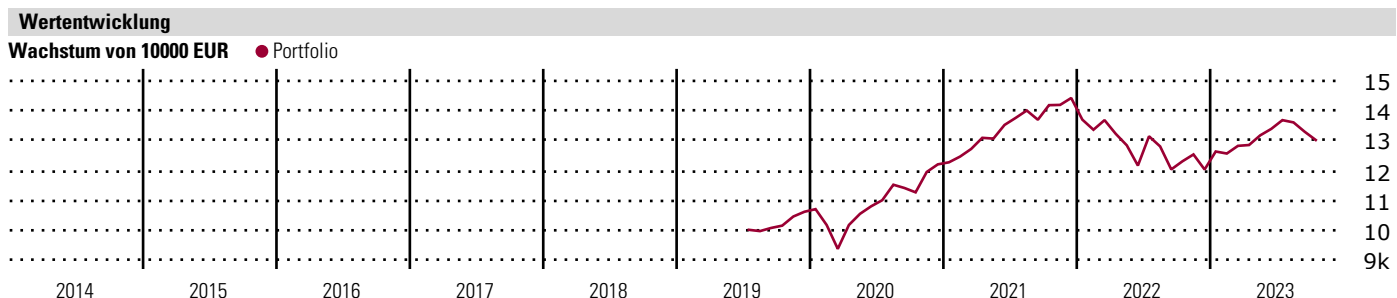
Top 10 der zugrundeliegenden Positionen

Gew. %	Name	Typ	Sektor	Land
10,22	TRS MSCI World NR USD	Total Return Swap	Nicht klassifiziert	USA
4,82	TRS Deutsche Bank Euro Overnight Rate TR	Total Return Swap	Nicht klassifiziert	USA
4,54	TRS Bloomberg Engy & Mtls EW TR EUR	Total Return Swap	Nicht klassifiziert	USA
3,17	Microsoft Corp	Aktien	Technologie	USA
1,95	Amazon.com Inc	Aktien	Konsumgüter zyklisch	USA
1,26	Alphabet Inc Class A	Aktien	Telekommunikation	USA
1,21	NVIDIA Corp	Aktien	Technologie	USA
1,13	Apple Inc	Aktien	Technologie	USA
1,03	Alphabet Inc Class C	Aktien	Telekommunikation	USA
0,83	Meta Platforms Inc Class A	Aktien	Telekommunikation	USA

Morningstar® Performance X-Ray

Wertentwicklung

31 Okt 2023

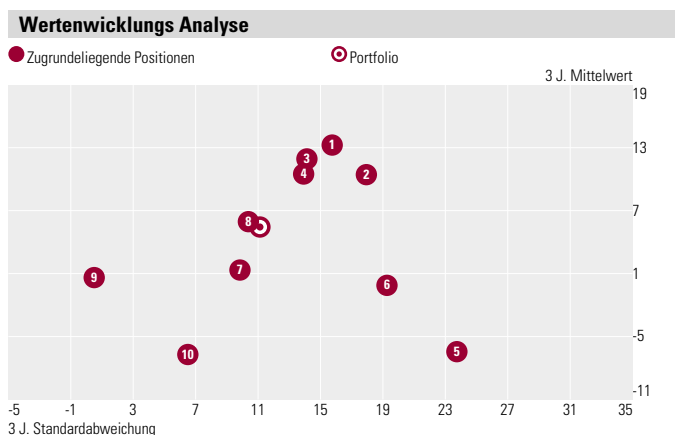


Rollierende Wertentwicklung %

	Portfolio
3 Monate	-4,87
6 Monate	1,31
1 Jahr	5,82
3 Jahre p.a.	4,95
5 Jahre p.a.	-
lfdJ.	8,23

Rollierende Wertentwicklung %

	Beste	Schlechteste
3 Monate	15,26 (Mrz 20-Jun 20)	-11,74 (Dez 19-Mrz 20)
6 Monate	21,81 (Mrz 20-Sep 20)	-15,73 (Dez 21-Jun 22)
1 Jahr	35,82 (Mrz 20-Mrz 21)	-16,64 (Dez 21-Dez 22)
3 Jahre p.a.	11,04 (Mrz 20-Mrz 23)	4,27 (Dez 19-Dez 22)
5 Jahre p.a.	- (---)	- (---)



Korrelationsmatrix

	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
1	1.00									
2	0.95	1.00								
3	0.93	0.91	1.00							
4	0.91	0.90	0.96	1.00						
5	0.79	0.79	0.79	0.82	1.00					
6	0.76	0.80	0.85	0.89	0.82	1.00				
7	0.90	0.88	0.91	0.93	0.87	0.88	1.00			
8	0.82	0.84	0.84	0.87	0.84	0.80	0.85	1.00		
9	-0.00	-0.00	-0.12	-0.12	0.18	-0.07	0.05	-0.00	1.00	
10	0.64	0.74	0.58	0.65	0.64	0.65	0.65	0.75	0.14	1.00

1.00 bis 0.60 0.60 bis 0.20 0.20 bis -0.20 -0.20 bis -0.60 -0.60 bis -1.00

Top 10 Positionen

Name	Gewicht %	Mittelwert	Std. Abw.
1 iShares DJ Global Titans 50 ETF (DE)	11,16	13,25	15,75
2 AB American Growth A EUR	10,93	10,43	17,94
3 Amundi IS MSCI World ETF C EUR EUR	10,22	11,93	14,13
4 Schroder ISF Gbl Sust Gr C Acc USD	9,94	10,49	13,92
5 MS INVF Global Opportunity AH EUR	8,11	-6,44	23,74
6 Threadneedle (Lux) Eur Smlr Com 1E EUR	6,91	-0,12	19,26
7 Phaidros Funds - Balanced D	4,97	1,34	9,84
8 Acatis Value Event Fonds C	4,96	5,95	10,38
9 Xtrackers EUR Overnight Rate Swap ETF 1C	4,82	0,62	0,50
10 SPDR® Blmbrg EUR Aggt Bd ETF	4,78	-6,71	6,50

Statistiken

Risiko und Rendite Statistiken










	3 Jahre	5 Jahre
Standardabweichung	11,12	-
Mittelwert	5,44	-
Sharpe Ratio	0,44	-

Überschneidungen

Überschneidungen

Das Portfoliodatum bezieht sich auf den aktuellsten verfügbaren Portfoliobestand in unserer Datenbank. Es kann vorkommen, dass zwei Fonds verschiedene Portfoliodaten haben.

Weitere Informationen finden Sie im letzten Abschnitt "Glossar".

Gewichtung im Name Portfolio (%)	ISIN	Gewichtung der Sektor Holdings (%)	Portfoliodatum
3,17 Microsoft Corp	US5949181045	 Technologie	
0,97 iShares DJ Global Titans 50 ETF (DE)	DE0006289382	8,68	17.11.2023
0,12 Acatis Value Event Fonds C	DE000A1T73W9	2,34	30.09.2023
1,22 AB American Growth A EUR	LU0232524495	11,14	31.10.2023
0,75 Schroder ISF Gbl Sust Gr C Acc USD	LU0557290854	7,57	31.10.2023
0,12 Phaidros Funds - Balanced D	LU0759896797	2,32	31.10.2023
1,95 Amazon.com Inc	US0231351067	 Konsumgüter zyklisch	
0,76 iShares DJ Global Titans 50 ETF (DE)	DE0006289382	6,79	17.11.2023
0,14 Acatis Value Event Fonds C	DE000A1T73W9	2,79	30.09.2023
0,58 AB American Growth A EUR	LU0232524495	5,26	31.10.2023
0,36 MS INVF Global Opportunity AH EUR	LU0557290854	4,49	31.10.2023
0,12 Phaidros Funds - Balanced D	LU0759896797	2,37	31.10.2023
1,26 Alphabet Inc Class A	US02079K3059	 Telekommunikation	
0,46 iShares DJ Global Titans 50 ETF (DE)	DE0006289382	4,14	17.11.2023
0,16 Acatis Value Event Fonds C	DE000A1T73W9	3,29	30.09.2023
0,51 Schroder ISF Gbl Sust Gr C Acc USD	LU0557290854	5,14	31.10.2023
0,13 Phaidros Funds - Balanced D	LU0759896797	2,56	31.10.2023
1,21 NVIDIA Corp	US67066G1040	 Technologie	
0,70 iShares DJ Global Titans 50 ETF (DE)	DE0006289382	6,27	17.11.2023
0,51 AB American Growth A EUR	LU0232524495	4,64	31.10.2023
1,13 Apple Inc	US0378331005	 Technologie	
0,90 iShares DJ Global Titans 50 ETF (DE)	DE0006289382	8,10	17.11.2023
0,13 Acatis Value Event Fonds C	DE000A1T73W9	2,65	30.09.2023
0,10 Phaidros Funds - Balanced D	LU0759896797	1,99	31.10.2023
1,03 Alphabet Inc Class C	US02079K1079	 Telekommunikation	
0,40 iShares DJ Global Titans 50 ETF (DE)	DE0006289382	3,56	17.11.2023
0,63 AB American Growth A EUR	LU0232524495	5,76	31.10.2023
0,83 Meta Platforms Inc Class A	US30303M1027	 Telekommunikation	
0,43 iShares DJ Global Titans 50 ETF (DE)	DE0006289382	3,84	17.11.2023
0,40 MS INVF Global Opportunity AH EUR	LU0552385618	4,99	31.10.2023
0,83 Adobe Inc	US00724F1012	 Technologie	
0,16 iShares DJ Global Titans 50 ETF (DE)	DE0006289382	1,42	17.11.2023
0,37 MS INVF Global Opportunity AH EUR	LU0552385618	4,61	31.10.2023
0,30 Schroder ISF Gbl Sust Gr C Acc USD	LU0557290854	2,97	31.10.2023
0,79 Visa Inc Class A	US92826C8394	 Finanzdienstleistungen	
0,23 iShares DJ Global Titans 50 ETF (DE)	DE0006289382	2,07	17.11.2023
0,56 AB American Growth A EUR	LU0232524495	5,13	31.10.2023
0,61 Xetra-Gold	DE000A0S9GB0	– Nicht klassifiziert	
0,50 HANSAgold EUR F hedged	DE000A2H68K7	11,04	30.09.2023
0,11 Phaidros Funds - Balanced D	LU0759896797	2,21	31.10.2023

Portfolio Positionen

Portfolio Positionen								
Name	Typ	Portfolio Datum	Morningstar Rating	1 Jahr	3 Jahre p.a.	5 Jahre p.a.	Laufende Gewichte	% Kosten
iShares DJ Global Titans 50 ETF (DE)	Fonds (ETF)	17 Nov 2023	★★★★★	11,81	12,74	12,18	0,51	11,16
AB American Growth A EUR	Fonds (OE)	31 Okt 2023	★★★★	8,37	9,25	13,30	1,74	10,93
Amundi IS MSCI World ETF C EUR EUR	Fonds (ETF)	31 Okt 2023	★★★★	2,93	11,54	9,59	0,38	10,22
Schroder ISF Gbl Sust Gr C Acc USD	Fonds (OE)	31 Okt 2023	★★★★★	3,71	9,99	13,04	0,84	9,94
MS INVF Global Opportunity AH EUR	Fonds (OE)	31 Okt 2023	-	21,62	-8,82	4,14	1,87	8,11
Threadneedle (Lux) Eur Smlr Com 1E EUR	Fonds (OE)	31 Okt 2023	★★★	1,94	-1,94	2,12	1,72	6,91
Phaidros Funds - Balanced D	Fonds (OE)	31 Okt 2023	★★★★★	5,24	0,87	4,75	1,68	4,97
Acatis Value Event Fonds C	Fonds (OE)	30 Sep 2023	★★★★★	9,54	5,57	5,72	1,80	4,96
Xtrackers EUR Overnight Rate Swap ETF 1C	Fonds (ETF)	31 Okt 2023	-	2,90	0,62	0,17	0,10	4,82
SPDR® Blmbrg EUR Aggt Bd ETF	Fonds (ETF)	31 Okt 2023	★★★	-0,57	-6,70	-2,16	0,17	4,78
Vanguard USD Corp Bd ETF USD Acc EUR	Fonds (ETF)	31 Okt 2023	★★★	-3,44	-2,00	-	0,09	4,73
SQUAD Aguja Opportunities R	Fonds (OE)	30 Sep 2023	★★★★	1,52	-1,05	5,41	1,79	4,70
Vanguard Global Aggt Bd ETF EUR H Acc	Fonds (ETF)	31 Okt 2023	★★★	-1,18	-6,52	-	0,10	4,66
HANSAgold EUR F hedged	Fonds (OE)	30 Sep 2023	-	12,65	-1,21	5,67	0,79	4,56
Amundi BI Equal-weight Comm ex-A UE A EUR	Fonds (ETF)	31 Okt 2023	-	-13,30	25,05	-	0,00	4,54

Glossar

Die in der Vergangenheit erzielten Erfolge sind keine Garantie für die zukünftige Entwicklung.

Die Erträge der Fonds reflektieren kein aktiven Handel und zeigen somit nicht notwendigerweise die Resultate die mit aktivem Management des Depots hätten erzielt werden können. Die erreichte Wertentwicklung anderer Kunden des Beraters kann grundlegend anders sein als die der hier gezeigten Investments.

Vermögensaufteilung

Das Kuchendiagramm und die Tabelle zeigen die Aufteilung des Portfolios nach folgenden Klassen: Aktien, Anleihen, Cash und Sonstige. Die Kategorie "Sonstige" repräsentiert eine Assetklasse die Morningstar zwar bekannt ist, jedoch in keine der voran genannten Kategorien passt. So sind beispielsweise Immobilien typischerweise der Kategorie "Sonstige" zugeordnet. "Nicht klassifiziert" wird den Titeln zugeordnet, die Morningstar nicht erkennt oder verfolgt. Die Tabelle neben dem Kuchendiagramm zeigt die prozentuale Netto-Vermögensaufteilung des Portfolios, ebenso wie die Long-Positionen (Vermögen) und Short-Positionen (Verbindlichkeiten) des Portfolios.

Weltregionen

Dieser Datensatz verdeutlicht die grobe geografische Aufteilung des Portfolios nach Region und Laufzeiten. Die Berechnung erfolgt auf dem Aktienanteil des Portfolios, Liquidität wird nicht berücksichtigt. "Nicht klassifiziert" wird dem Aktienanteil des Portfolios zugewiesen, bei dem Morningstar die Herkunft oder Region nicht bestimmen kann.

Branchensektoren

Diese Tabelle zeigt den Prozentsatz des Portfolio-Aktienanteils, welcher jedem der drei Supersektoren (Information, Service und Produktion) und den 12 wichtigsten Industriesubsektoren zugeordnet ist. "Nicht klassifiziert" bezieht sich auf die Titel, die Morningstar nicht kennt oder verfolgt.

Top 10 Positionen

Diese Aufzählung zeigt bis zu 10 der am höchsten gewichteten dem Portfolio zugrunde liegende Positionen. Dargestellt werden der prozentuale Anteil im Portfolio, der Wertpapiertyp, die Sektorklassifizierung und das Ursprungsland.

Wertentwicklung

Die Wertentwicklung wird ohne Ausgabeaufschläge oder steuerliche Faktoren berechnet. Jedoch sind alle laufenden Kosten des Fonds berücksichtigt, Ausschüttungen werden als wieder angelegt angenommen. Ausgabeaufschläge oder Kaufgebühren würden die ausgewiesene Wertentwicklung reduzieren.

Die Wertentwicklungen der Portfolios werden wie folgt berechnet: die monatlichen Wertentwicklungen der zugrunde liegenden Titel werden gemäß der Vermögensaufteilung gewichtet und zeigen so den (Vorsteuer)Ertrag den ein Investor bei monatlicher Neugewichtung seines Portfolios erzielt hätte. Die selben Werte werden zur Berechnung der statistischen Kennziffern verwandt. Die Erträge einzelner Titel sind prozentuale Wertentwicklungen.

Risiko-Ertragsprofil

Das Sharpe-Ratio ist eine risikoadjustierte Kennzahl, berechnet mittels Standardabweichung und Mehrertrag, die den Ertrag pro Risikoeinheit darstellt. Je höher das Sharpe-Ratio, desto besser ist die historische risikoadjustierte Wertentwicklung. Das Sharpe-Ratio wird über die letzten 36 Monatperioden berechnet. Hierbei wird der Mehrertrag durch die Standardabweichung des Mehrertrages des Fonds dividiert. Da diese Kennzahl die Standardabweichung als Risikodeterminante heranzieht, wird die höchste Aussagekraft erzielt wenn ein Fonds analysiert wird, der die einzige Position eines Investors darstellt. Das Sharpe-Ratio kann benutzt werden um zwei Fonds direkt miteinander zu vergleichen um herauszufinden, wieviel Risiko ein Fonds aufnehmen muss um einen Mehrertrag gegenüber einer risikolosen Anlage zu erreichen.

Die Standardabweichung verdeutlicht, wie weit die Werte einer Wertewolke sich über- und unterhalb des Durchschnittes befinden. Ist die Standardabweichung eine hohe positive oder negative Zahl, dann hat sich der Fonds entsprechend weit über oder dem Durchschnitt entwickelt. Ist die Standardabweichung gering, dann hat der Fonds sich näher am Durchschnitt entwickelt.

Der Mittelwert ist die annualisierte Wertentwicklung eines Fonds über drei Jahre.

Chart

Die Wertentwicklungen werden ohne Ausgabeaufschläge oder steuerliche Faktoren berechnet. Jedoch sind alle laufenden Kosten des Fonds berücksichtigt, Ausschüttungen werden als wieder angelegt angenommen. Ausgabeaufschläge oder Kaufgebühren würden die ausgewiesene Wertentwicklung reduzieren.

Risiko-Ertrag Punktediagramm

Das Risiko-Ertrags Diagramm basiert auf dem Risiko- und Ertragsprofil jeder zugrunde liegenden Position über die letzte 3-Jahresperiode. Das Risiko wird als 3-Jahres Standardabweichung des Ertrages gemessen. Der Ertrag wird als 3-Jahres Durchschnittsertrag gemessen. Das Risiko-Ertrags Diagramm zeigt weiterhin das Risiko und den Ertrag des Portfolios.

Korrelationsmatrix

Diese Matrix zeigt die Korrelation der Performance zwischen den unterschiedlichen Positionen. Eine Korrelation von 1 besagt dass zwei Positionen sich in die selbe Richtung bewegen, eine Korrelation von -1 besagt dass zwei Positionen in gegensätzliche Richtungen bewegen und eine Korrelation von 0 bedeutet, dass keine Korrelation besteht. Eine Korrelation von -1 bietet eine maximale Diversifikation.