



RIC Sharpe Selektor Dachfonds-Strategie

Nur zur professionellen und institutionellen Verwendung, nur zum internen Gebrauch

31. Dezember, 2020

Geplante Portfolio Daten

Initiator:	RIC Consulting
Währung:	EUR
Rechtsform:	UCITS Publikumsfonds
Domizil:	Deutschland
Verwahrung:	
KVG Verwaltung:	
Investment Manager:	
Ertragsverwendung:	Thesaurierend
Management Fee:	1,5
Liquidität:	Börsentäglich
Ausgabeaufschlag:	2,00%
Rückgabeabschlag:	0,00%
Portfoliobereiter:	RIC Consulting
Auflegung:	

Investment Ziele & Strategie

Die „RIC Sharpe Selektor Dachfonds Strategie“ besteht aus einer Reihe gründlich selektierter Zielfonds, die im ersten Schritt eine sehr strenge Top-Down Analyse bestehen.

Die strategische Allokation des Portfolios basiert auf einer algorithmisch gewichteten Verteilung auf Paare oder Gruppen von Fonds mit geringer Korrelation. Die Auswahl der zugrunde liegenden Fonds besteht aus einer Reihe von parametrisierten Regeln und Kriterien im Bezug auf einer bestimmten Korrelation innerhalb verschiedener Zeitfenster, einer definierten Volatilität, Value-at-Risk und einer zusätzlichen Parität.

Das Ergebnis ist ein Portfolio unterschiedlicher Strategien, die zu einer attraktiven Rendite bei einem Sharpe-Ratio zwischen 1 und 1,5 führen. Während des Live-Forward-Tests in den Jahren 2015 bis 10/2020 konnte die SIV Variante der Sharpe-Selector-Strategie trotz des schwierigen Marktumfelds sehr anständige Ergebnisse erzielen.

Mehr als 60% der zugrunde liegenden Fonds werden als Aktienfonds gewählt, um VWL-Sparer Kriterien zu entsprechen. Die übrigen Zielfonds sind eine Mischung aus regelbasierten oder quantitativen Modellen mit möglichst wenig menschlichem Eingriff oder haben einen systematischen Ansatz mit antizyklischem und konträrem Charakter zu den meisten Aktienfonds, um eine ausgeglichene Volatilität zu erreichen.

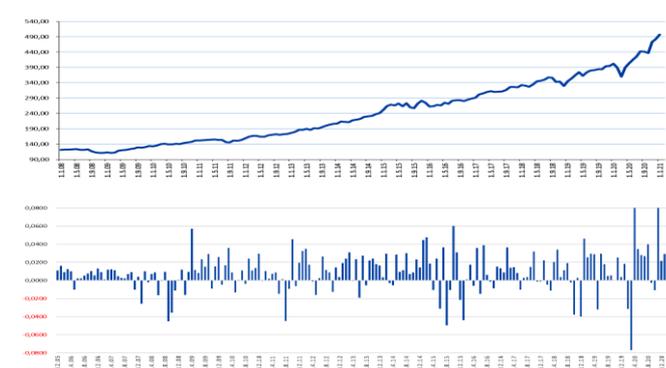
Live Forward-Test 2015-2020 und Backtest der RIC Strategie auf echte Nettoinventarwerte der Zielfonds, korrigiert und rebalanced nach allen Kosten

in %	Jan.	Feb.	Mar.	Apr.	Mai	Jun.	Jul.	Aug.	Sep.	Okt.	Nov.	Dez.	jährliche Rendite
2020	1,82	-3,14	-7,71	8,39	3,45	2,80	2,68	3,98	-0,26	-1,09	8,17	2,15	25,10
2019	5,45	2,95	2,56	3,71	-4,24	3,30	2,37	-0,91	1,14	0,16	3,08	1,07	23,01
2018	2,16	-0,78	-1,12	2,38	3,01	0,50	1,61	1,85	0,01	-4,01	0,37	-5,00	0,55
2017	0,90	3,70	1,46	1,40	0,57	-0,78	0,02	0,35	1,71	3,07	-0,23	-0,13	12,83
2016	-4,96	0,05	1,42	-0,28	3,58	-1,95	3,74	0,63	-0,29	-0,05	2,08	1,69	5,36
2015	4,45	4,67	1,73	-0,90	2,64	-2,91	3,70	-5,05	-1,01	5,90	3,41	-2,23	14,66
2014	0,36	2,84	0,04	-0,26	2,65	0,57	1,50	3,00	1,14	0,68	2,00	1,44	17,49
2013	2,04	2,45	3,35	-0,17	2,67	-1,56	2,52	-0,33	1,82	2,42	2,02	1,79	21,24
2012	3,14	3,26	1,90	-0,18	-1,66	0,45	2,84	1,08	0,74	-1,14	1,22	0,19	12,52
2011	0,05	0,86	0,18	0,30	1,17	-1,13	-0,21	-4,51	-0,52	4,21	-0,08	1,75	1,71
2010	-0,38	1,76	3,47	0,89	-1,20	-0,13	0,80	-0,55	2,30	1,21	1,67	3,07	13,88
2009	1,08	-1,38	0,67	5,56	1,35	0,71	2,26	1,72	2,55	-0,97	1,52	2,56	20,72
2008	-1,75	0,96	-0,11	0,71	0,73	-1,21	0,04	0,89	-3,65	-2,70	-0,82	0,49	-5,35

Risikokennzahlen

	Jan 2018 YTD	3 Jahre Jan 2017 Dec 2019	5 Jahre Jan 2015 Dec 2019	10 Jahre Jan 2010 Dec 2019
Annualisierte Rendite	14,56%	11,52%	10,88%	11,90%
Bester Monat	8,39%	5,45%	5,90%	5,90%
Schlechtester Monat	-7,71%	-5,00%	-5,05%	-5,05%
Annualisierte Volatilität	11,45%	7,75%	8,75%	7,27%
Sharpe Ratio	1,29	1,49	1,19	1,50
Sortino Ratio	2,55	2,51	2,35	3,05
Omega Ratio	2,54	3,02	2,50	3,35
Schiefe	-0,41	-0,80	-0,55	-0,63
Krümmung	1,10	1,13	0,19	0,95

Kursentwicklung Grafik 01.01.2008 - YTD



Das Portfoliomodell auf dieser Seite wurde entwickelt, um den allgemeinen internationalen regulatorischen Anforderungen gemäß OGAW zu entsprechen. Dieses Informationsblatt ist jedoch nur für qualifizierte, institutionelle und professionelle Anleger gemacht. Die Wertentwicklung der Vergangenheit ist keine Garantie für zukünftige Entwicklungen. Die Wertentwicklung einer Anlage in Fonds kann im Laufe der Zeit erheblich variieren und unterscheidet sich von Anlagen in traditionellen Aktien und Anleihen. Anleger tragen das Risiko des Verlustes ihres Anlagevermögens und sollten daher die Angemessenheit solcher Anlagen sorgfältig prüfen. Das hierin beschriebene Anlagemodell eignet sich für alle Anleger, die die Risiken von Anlagen in Investmentfonds gründlich bewertet und vollständig verstanden haben. Die langfristigen Anlageziele und Risikoparameter der Investoren sollten so angelegt sein, dass Investitionen in diese Art von Investmentfonds sinnvoll für sie sind. Vertraulich, nur für ausgesuchte Empfänger, nicht weiterleiten, nicht für den öffentlichen Vertrieb, vorläufige und indikative Zahlen, keine gesetzliche Haftung.