



RIC Sharpe Selektor FoHF AIF

Nur zur professionellen und institutionellen Verwendung, nur zum internen Gebrauch

30. Juni, 2022

Geplante Portfolio Daten

Initiator:	RIC Consulting
Währung:	EUR
Rechtsform:	Zertifikat (geplant)
Domizil:	Listing Börse Düsseldorf
Verwahrung:	
KVG Verwaltung:	
Investment Manager:	
Ertragsverwendung:	Thesaurierend
Management Fee:	
Liquidität:	wöchentlich (geplant)
Ausgabeaufschlag:	0,00%
Rückgabeabschlag:	0,00%
Portfoliomanager:	SharpePlus GmbH / BN Partners
Auflegung:	a.s.a.p.

Investment Ziele & Strategie

Die „RIC Sharpe Selector FoHF AIF“ besteht aus einer Reihe gründlich selektierter Investment-Fonds, die im ersten Schritt eine sehr strenge Top-Down Analyse durchlaufen. 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 einigen weiteren strengen Qualitätsmerkmalen.

Die strategische Allokation des Portfolios wird mit dem Ziel möglichst konträre Stile mit definierter Korrelation innerhalb verschiedener Zeitfenster und einer definierter maximalen Zielvolatilität algorithmisch gleichverteilt.

Das Ergebnis ist ein Portfolio unterschiedlicher Strategien, die zu einer stabilen Wertentwicklung bei einem Sharpe-Ratio zwischen 1,8 und 2,5 führen. Während des Live-Forward-Tests in den Jahren 2016 bis 03/2022 konnte die Sharpe-Selector-Strategie trotz des schwierigen Marktumfelds sehr anständige Ergebnisse erzielen.

Die Zielfonds sind eine Mischung aus regelbasierten oder quantitativen Modellen mit möglichst wenig diskretionärem Management oder haben einen systematischen Ansatz mit antizyklischem und konträrem Charakter zu den meisten Aktienfonds. Zusätzlich bilden wir mit einem Overlay-Management Modell die Vorteile aus der impliziten gegenüber der realisierten Volatilität von Optionen ab. Das Portfolio kann auch mit einer Absicherung gegen starke Kurseinbrüche ausgestattet werden. (Seite 2)

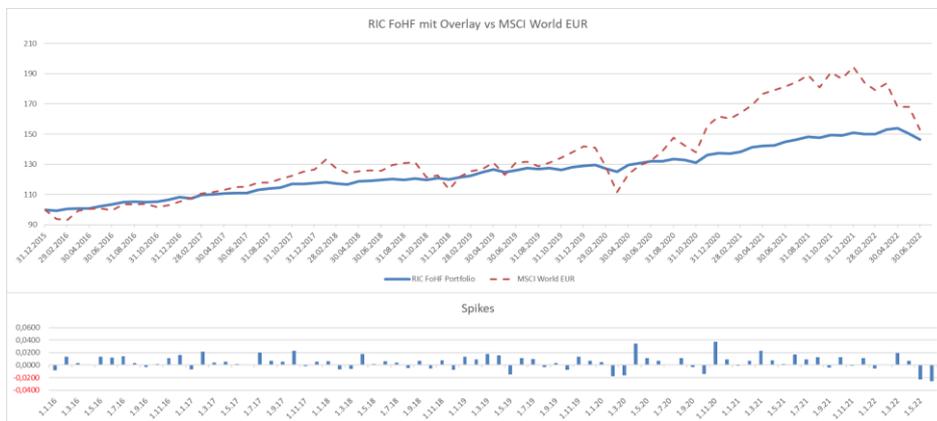
Live Forward-Test 2016-2021 Strategie auf Nettoinventarwerte der Zielfonds, nach allen Kosten

	Jan.	Feb.	Mar.	Apr.	Mai	Jun.	Jul.	Aug.	Sep.	Okt.	Nov.	Dez.	Ergebnis p.a.
2022	-0,54	-0,03	1,92	0,72	-2,32	-2,56	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	-2,39
2021	-0,76	0,96	1,62	1,30	0,43	1,91	1,12	1,57	-0,62	1,56	-0,38	0,91	11,02
2020	0,84	-2,82	-2,86	3,75	1,99	1,84	0,77	1,69	0,28	-1,44	3,30	1,20	8,07
2019	0,53	0,80	1,17	1,69	-1,80	0,95	0,45	-0,17	0,70	-0,38	1,29	0,79	6,55
2018	0,48	0,14	1,07	1,24	0,53	0,72	-0,40	-0,52	0,30	0,18	0,97	0,53	5,35
2017	0,17	1,95	0,53	1,51	0,23	-0,10	0,29	0,66	1,16	2,20	-0,69	0,50	8,80
2016	-1,81	0,82	0,71	-0,05	2,64	-0,54	1,81	0,33	-0,08	-0,17	1,21	1,44	6,25

Risikokennzahlen

	Forward Test Jan 16 YTD
Jährl. Rendite	6,06%
Bester Monat	3,72%
Schlecht. Monat	-2,56%
Jährl. Volatilität	3,93%
Sharpe Ratio	1,64
Sortino Ratio	3,39
Omega	3,11
Schiefe	-0,08
Krümmung	0,92

Kursentwicklung Grafik 01.01.2016 - YTD



Das Portfoliomodell auf dieser Seite wurde entwickelt, um den allgemeinen internationalen regulatorischen Anforderungen gemäß SIF AIF zu entsprechen. Dieses Informationsblatt und ist 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.



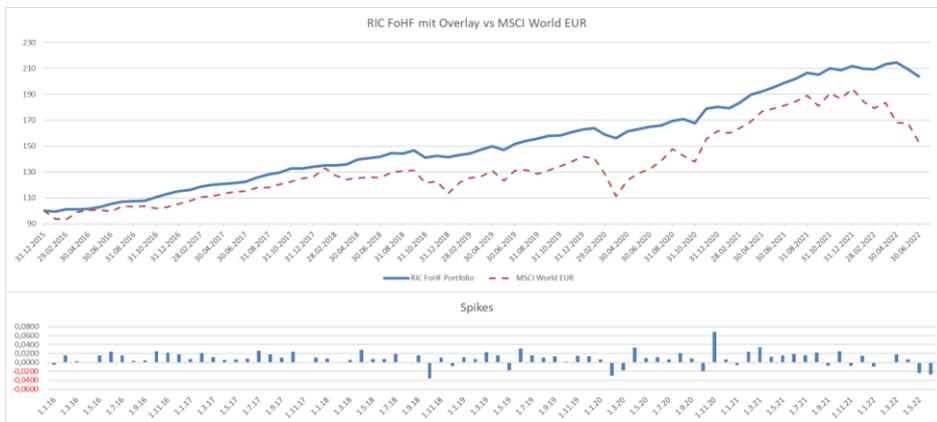
Live Forward-Test 2016-2021 Strategie auf Nettoinventarwerte der Zielfonds, nach allen Kosten mit Overlay

	Jan.	Feb.	Mar.	Apr.	Mai	Jun.	Jul.	Aug.	Sep.	Okt.	Nov.	Dez.	Ergebnis p.a.
2022	-0,93	-0,14	1,83	0,62	-2,42	-2,66	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	-2,79
2021	-1,31	2,65	2,75	1,85	1,86	2,14	1,82	2,51	-0,93	2,80	-1,02	1,30	18,00
2020	1,02	-3,96	-2,98	3,64	1,88	2,31	1,36	2,67	1,44	-2,07	6,40	0,99	12,24
2019	0,42	0,70	1,68	1,73	-2,11	2,92	1,04	1,26	1,78	0,51	1,45	1,46	13,55
2018	0,77	0,79	2,24	2,28	1,07	0,80	1,11	-0,24	1,18	-2,90	1,23	0,42	8,84
2017	1,68	1,88	1,29	1,55	0,78	0,84	0,93	1,71	1,70	2,38	-0,48	1,03	15,90
2016	-1,46	1,12	0,61	-0,15	2,86	0,67	1,94	0,37	0,67	2,19	2,32	1,59	12,82

Risikokennzahlen mit Overlay

	Forward Test Jan 16 YTD
Jährl. Rendite	11,58%
Bester Monat	6,82%
Schlecht. Monat	-3,64%
Jährl. Volatilität	5,48%
Sharpe Ratio	2,19
Sortino Ratio	4,59
Omega	4,34
Schiefte	-0,14
Krümmung	2,55

Kursentwicklung Grafik mit Overlay 01.01.2016 - YTD



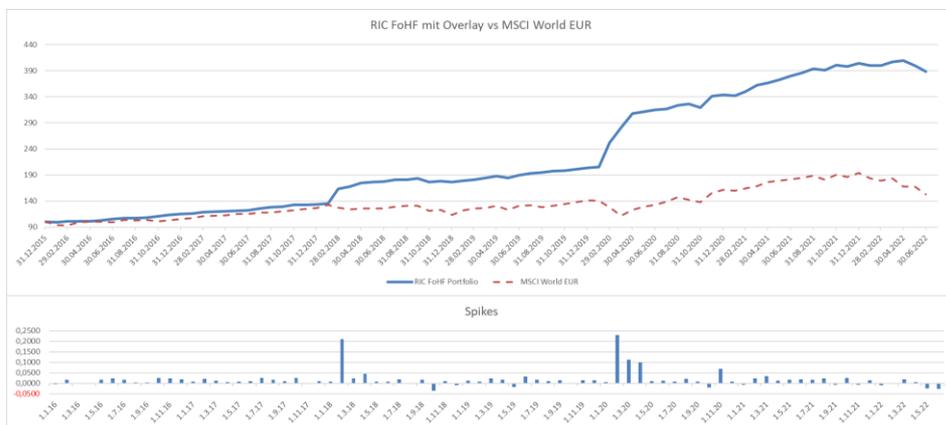
Live Forward-Test 2016-2021 Strategie auf Nettoinventarwerte der Zielfonds, nach allen Kosten mit Overlay und Hedge

	Jan.	Feb.	Mar.	Apr.	Mai	Jun.	Jul.	Aug.	Sep.	Okt.	Nov.	Dez.	Ergebnis p.a.
2022	-0,93	-0,14	1,83	0,62	-2,42	-2,66	0,47	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	-2,79
2021	-0,64	2,39	3,39	1,31	1,61	1,91	1,58	2,22	-0,74	2,52	-0,77	1,50	18,25
2020	0,67	22,97	11,22	9,83	1,01	1,18	0,69	2,09	0,85	-2,02	6,82	0,71	62,54
2019	1,22	0,77	2,25	1,60	-1,82	3,10	1,61	1,11	1,40	0,14	1,48	1,33	14,85
2018	0,88	21,01	2,37	4,44	0,72	0,72	1,90	-0,20	1,56	-3,64	1,03	-0,86	30,70
2017	0,80	2,09	1,16	0,61	0,70	0,92	2,61	1,77	1,11	2,44	0,04	1,07	16,22
2016	-0,51	1,61	0,24	0,01	1,59	2,42	1,57	0,34	0,45	2,54	2,21	1,81	14,52

Risikokennzahlen mit Overlay & Hedge

	Forward Test Jan 16 YTD
Jährl. Rendite	23,24%
Bester Monat	22,97%
Schlecht. Monat	-3,64%
Jährl. Volatilität	13,54%
Sharpe Ratio	1,75
Sortino Ratio	10,36
Omega	9,31
Schiefte	3,86
Krümmung	17,80

Kursentwicklung Grafik mit Overlay & Hedge 01.01.2016 - YTD



Das Portfoliomodell auf dieser Seite wurde entwickelt, um den allgemeinen internationalen regulatorischen Anforderungen gemäß SIF AIF zu entsprechen. Dieses Informationsblatt und ist 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.