



RIC Sharpe Selector Strategie

Nur zur professionellen und institutionellen Verwendung, nur zum internen Gebrauch

31. Dezember, 2022

Geplante Portfolio Daten

Initiator:	RIC Consulting
Währung:	EUR
Rechtsform:	
Domizil:	
Verwahrung:	
KVG-Verwaltung:	
Investment Manager:	
Ertragsverwendung:	Ausschüttung oder Thesaurierung
TER & Performance Fee	1% p. a. + Performance Fee 15% bei X > 0 & High Watermark
Liquidität:	wöchentlich (geplant)
Ausgabeaufschlag:	0,00%
Rückgabeabschlag	0,00%
Portfoliomanager:	SharpePlus GmbH / BN Partners
Auflegung:	a.s.a.p. / Jan 2023

Investment Ziele & Strategie

Die „RIC Sharpe Selector“ Strategie besteht aus einer Reihe gründlich selektierter Investment-Fonds mit möglichst konträren Stilen, 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 in Bezug auf eine bestimmte Korrelation innerhalb verschiedener Zeitfenster, einer definierten Volatilität, Value-at-Risk und einigen weiteren strengen Qualitätsmerkmalen.

Die strategische Allokation des Portfolios wird mit vordefinierten Korrelationen innerhalb verschiedener Zeitfenster und vorgegebener Volatilität algorithmisch ermittelt und umgesetzt.

Das Ergebnis ist ein Portfolio unterschiedlicher Strategien, die zu einer stabilen Wertentwicklung bei einem Sharpe-Ratio zwischen 1,8 und 2,5 führen.

Die Zielfonds sind eine Mischung aus Strategien mit regelbasierten Investmentprozessen und möglichst wenig diskretionärem Management oder haben einen systematischen Ansatz mit antizyklischem und konträrem Charakter zu den meisten Aktienfonds. Zusätzlich addieren wir zur Absicherung des Portfolios und zur Senkung der Volatilität zwei signalgesteuerte Overlay- Modelle unter Nutzung der Vorteile der impliziten gegenüber der realisierten Volatilität von Optionen und eine weitere Short-Strategie zur Addition einer positiven Wertentwicklung bei fallenden Kapitalmärkten.

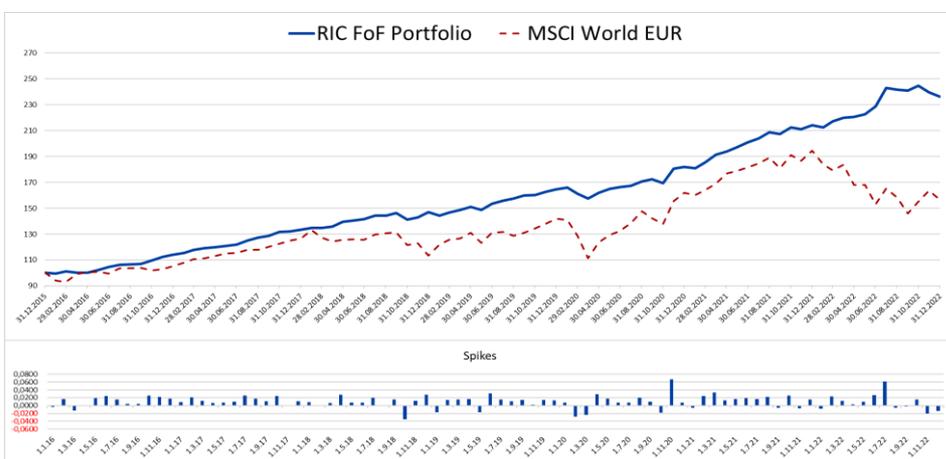
Live Forward-Test 2016 - YTD Strategie auf Nettoinventarwerte der Zielfonds, nach allen Kosten mit Overlays 1 & 2

	Jan.	Feb.	Mar.	Apr.	Mai	Jun.	Jul.	Aug.	Sep.	Okt.	Nov.	Dez.	Ergebnis p. a.
2022	-0,83	2,29	1,20	0,36	0,92	2,70	6,14	-0,57	-0,25	1,53	-2,07	-1,34	11,16
2021	-0,55	2,39	3,35	1,34	1,66	1,90	1,60	2,22	-0,64	2,50	-0,68	1,51	18,59
2020	0,71	-2,80	-2,33	2,88	1,81	0,77	0,75	2,03	0,93	-1,87	6,69	0,74	10,77
2019	-1,75	1,44	1,58	1,61	-1,67	3,12	1,57	1,12	1,44	0,24	1,48	1,37	15,22
2018	0,92	0,06	0,67	2,81	0,79	0,75	1,94	-0,10	1,57	-3,54	1,22	2,78	6,83
2017	0,92	2,05	1,19	0,65	0,76	0,98	2,56	1,80	1,15	2,39	0,11	1,11	16,60
2016	-0,40	1,68	-1,24	0,09	1,90	2,41	1,54	0,38	0,45	2,60	2,23	1,79	13,72

Risikokennzahlen mit Overlays 1 & 2

	Forward Test Jan 16 - YTD
Jährl. Rendite	13,07%
Bester Monat	6,69%
Schlecht. Monat	-3,54%
Jährl. Volatilität	5,58%
Sharpe Ratio	2,37
Sortino Ratio	5,76
Omega	5,98
Schiefte	0,08
Krümmung	2,74

Grafik mit Overlays 1 & 2 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.