

Morningstar® Performance X-Ray

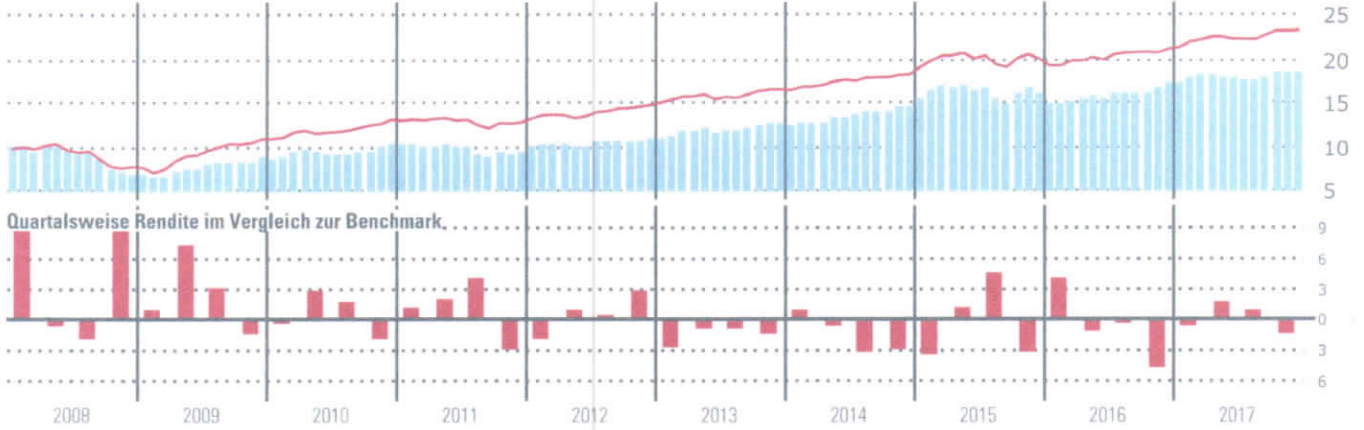
Benchmark

Wertentwicklung

31 Dez 2017

Rendite

Wachstum von 10000 EUR ● Portfolio ● Benchmark



Rollierende Renditen %

	Portfolio	Bmark
3 Monate	2,14	3,43
6 Monate	4,08	4,48
1 Jahr	9,45	8,32
3 Jahre p.a.	8,27	8,19
5 Jahre p.a.	9,35	11,38
lfd.J.	9,45	8,32

Rollierende Wertentwicklung %

	Beste	Neg.
3 Monate	27,80 (Feb 09-Mai 09)	-20,91 (Aug 08-Nov 08)
6 Monate	42,68 (Feb 09-Aug 09)	-27,26 (Mai 08-Nov 08)
1 Jahr	57,98 (Feb 09-Feb 10)	-29,96 (Feb 08-Feb 09)
3 Jahre p.a.	24,46 (Feb 09-Feb 12)	7,53 (Aug 14-Aug 17)
5 Jahre p.a.	18,91 (Feb 09-Feb 14)	7,02 (Dez 07-Dez 12)

Rendite Analyse



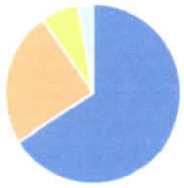
Korrelationsmatrix

	1	2	3	4	5	6	7	8	9
1	1,00								
2	0,85	1,00							
3	0,83	0,88	1,00						
4	0,81	0,75	0,80	1,00					
5	0,74	0,85	0,74	0,72	1,00				
6	0,55	0,49	0,48	0,68	0,36	1,00			
7	0,52	0,39	0,36	0,43	0,49	0,10	1,00		
8	0,73	0,82	0,71	0,58	0,77	0,26	0,38	1,00	
9	0,74	0,74	0,61	0,55	0,65	0,41	0,62	0,68	1,00

1,00 To 0,60 0,60 To 0,20 0,20 To -0,20 -0,20 To -0,60 -0,60 To -1,00

Morningstar® Portfolio X-Ray

Vermögensaufteilung

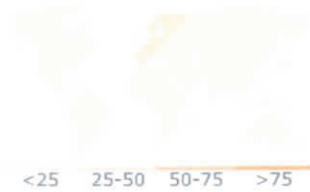


Vermögensaufteilung	Portfolio	Bmark
• Aktien	66,14	0,00
• Anleihen	24,20	0,00
• Cash	6,96	0,00
• Sonstige	2,71	100,00
• Nicht klassifiziert	0,00	0,00

Top 10 Länder %

Land	Portfolio	Land	Portfolio
USA	13,79	Grossbritannien	3,44
Deutschland	13,77	Indien	2,89
Frankreich	5,30	Japan	2,68
Schweiz	4,05	China	2,60
		Südkorea	2,29

Regionale Aufteilung %



Region	Portfolio
Europa	36,13
Großbritannien	3,44
Euroland	26,24
Westeuropa ex Euro	6,30
Schwed. Europa	0,02
Afrika	0,12

Amerika	Portfolio	Asien	Portfolio
Amerika	14,71	Asien	15,55
USA	13,79	Japan	2,68
Kanada	0,40	Australasien	0,25
Lateinamerika	0,52	4 Tiger	5,16
		Asien ex- 4 Tiger	7,45

Nicht klassifiziert 33,62

Aktiensektor %



▲ Benchmark
● Portfolio

Zyklisch	Portfolio
Zyklisch	31,23
Rohstoffe	6,61
Konsumgüter zyklisch	13,60
Finanzdienstleistungen	9,71
Immobilien	1,31

Sensibel	Portfolio
Sensibel	22,80
Telekommunikation	1,88
Energie	0,75
Industriewerte	10,22
Technologie	9,96

Defensiv	Portfolio
Defensiv	12,35
Konsumgüter n. zykl.	5,29
Gesundheitswesen	5,91
Versorger	1,15

Anlagestil

Wert	Blend	Wachstum	Größe
14	22	19	Groß
12	8	0	Mittel
6	4	8	Klein

Anlagestil: <10 10-25 25-50 >50

Anlagestil Aktien	Portfolio
Kurs/Buch	2,58
KGV	17,03
Kurs-Cashflow	9,42

Zinssensibilität	Portfolio		
0	0	17	Hoch
0	0	5	Mittel
25	53	0	Niedrig

Zinssensibilität: <10 10-25 25-50 >50

Anlagestil Anleihen	Portfolio
Effektive Duration	4,69
Durchschn. Restlaufzeit	7,11
Durchschnittliche Bonität	BB

Top 10 der zugrundeliegenden Positionen

Gew. %	Name	Typ	Sektor	Land
1,25	Alphabet Inc A	Aktien	Technologie	USA
1,03	STADA Arzneimittel AG	Aktien	Gesundheitswesen	Deutschland
0,97	Berkshire Hathaway Inc B	Aktien	Finanzdienstleistungen	USA
0,89	Daimler AG	Aktien	Konsumgüter zyklisch	Deutschland
0,86	Grenkeleasing AG	Aktien	Finanzdienstleistungen	Deutschland
0,81	freenet AG	Aktien	Telekommunikation	Deutschland
0,75	Novo Nordisk A/S B	Aktien	Gesundheitswesen	Dänemark
0,72	Nestle SA	Aktien	Konsumgüter n. zykl.	Schweiz
0,71	Bajaj Holdings and Investment Ltd	Aktien	Finanzdienstleistungen	Indien
0,60	Nike Inc B	Aktien	Konsumgüter zyklisch	USA