

Fondsname

Anbieter

Zeitraum

Details

Kategorie	-
Subkategorie	-
ISIN	-
Fondstyp	-
Währung	-
Mittelverwendung	-
Verwahrstelle	-

Benchmarks

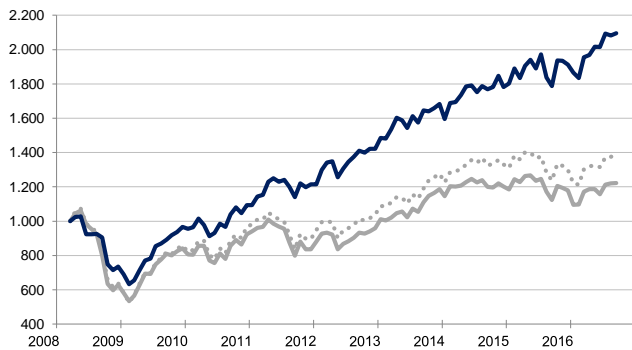
Benchmark 1	Active Manager Benchmark
Benchmark 2	MSCI ACWI Daily TR Gross USD

Rendite		Risiko	
Letzter Monat	0,64%	Standardabweichung p.a.	14,61%
Year to Date	9,57%	Downside Dev p.a. (0%)	9,90%
Rendite p.a. seit Auflage	9,10%	Value at Risk (95%) p.m.	-6,12%
1 Jahr	17,22%	Value at Risk (99%) p.m.	-8,99%
3 Jahre (p.a.)	8,40%	Korrelation Benchmark 1	0,89
5 Jahre (p.a.)	12,95%	Korrelation Benchmark 2	0,90
Bester Monat	9,34%	Beta Benchmark 1	0,74
% positive Monate	62,75%	Beta Benchmark 2	0,74

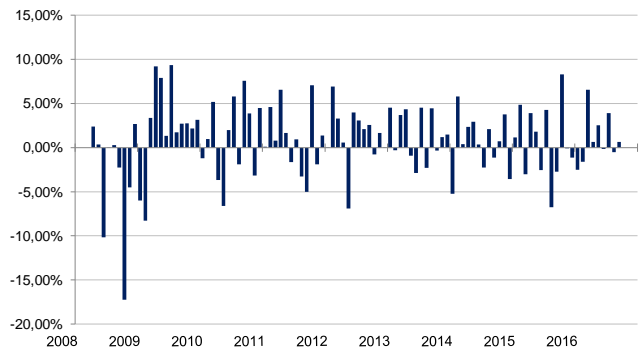
Extremrisiko		Performance	
Max. Drawdown	-38,39%	Sharpe Ratio ⁽²⁾	0,56
Schlechtester Monat	-17,25%	Sortino Ratio ⁽²⁾	0,81
Modified VaR (95%) p.m.	-7,00%	Treynor Ratio ^{(2) (3)}	0,11
Modified VaR (99%) p.m.	-13,21%	Information Ratio ⁽³⁾	0,65
Conditional VaR (95%) p.m.	-9,33%	Omega Ratio (0%)	1,67
Conditional VaR (99%) p.m.	-13,71%		
Schiefe	-0,91		
Wölbung	2,66		

(2) risikoloser Zins = 3M Euribor
(3) Benchmark 2

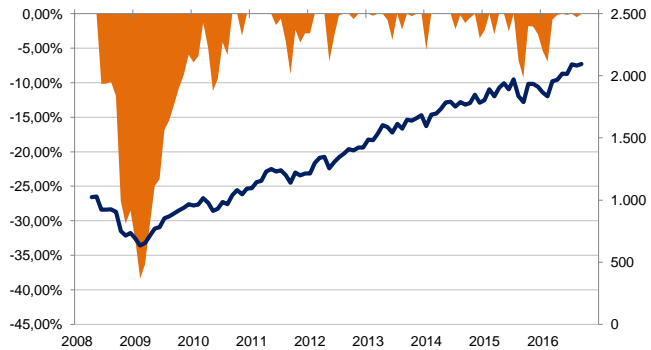
Wertentwicklung vs. Benchmarks



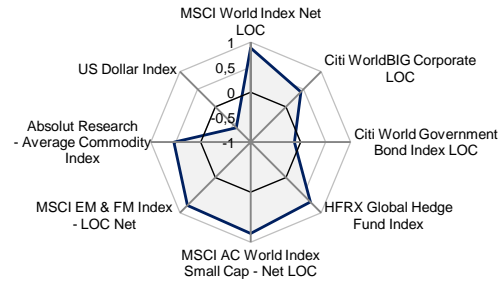
Monatliche Renditen



Wertentwicklung und Drawdowns



Korrelationen



Historische Renditen

	Jan	Feb	Mrz	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	Jahr
2016	-2,52%	-1,61%	6,55%	0,66%	2,53%	-0,16%	3,91%	-0,51%	0,64%				9,57%
2015	1,16%	4,86%	-3,00%	3,90%	1,82%	-2,54%	4,27%	-6,75%	-2,73%	8,29%	-0,07%	-1,14%	7,33%
2014	-5,24%	5,81%	0,38%	2,35%	2,93%	0,37%	-2,25%	2,09%	-1,13%	0,73%	3,76%	-3,55%	5,86%
2013	4,51%	-0,29%	3,69%	4,36%	-0,92%	-2,89%	4,51%	-2,29%	4,46%	-0,35%	1,20%	1,47%	18,44%
2012	-0,02%	6,93%	3,30%	0,58%	-6,91%	3,99%	3,09%	2,11%	2,58%	-0,78%	1,66%	-0,03%	17,07%
2011	0,12%	4,61%	0,80%	6,57%	1,65%	-1,64%	0,94%	-3,26%	-5,00%	7,07%	-1,90%	1,39%	11,12%
2010	-1,19%	0,97%	5,18%	-3,65%	-6,62%	2,00%	5,81%	-1,90%	7,59%	3,89%	-3,17%	4,51%	13,07%
2009	-6,00%	-8,28%	3,36%	9,20%	7,90%	1,34%	9,34%	1,73%	2,70%	2,74%	2,18%	3,15%	31,65%
2008				2,39%	0,37%	-10,18%	0,05%	0,28%	-2,27%	-17,25%	-4,51%	2,67%	-26,58%
2007													
2006													

— Fondsname — Active Manager Benchmark MSCI ACWI Daily TR Gross USD

⁽¹⁾ Die Strategiebeschreibungen basieren auf den Angaben der Fonds-/Indexanbieter.
 Absolut Research GmbH, Große Elbstraße 277a, 22767 Hamburg, Germany | www.absolut-research.de | info@absolut-research.de | Tel: +49(0)40-303779-0
Haftungsbeschränkung: Informationen werden ausschließlich zur individuellen Information des Rezipienten ohne Gewähr für Vollständigkeit, Richtigkeit und Genauigkeit zur Verfügung gestellt. Die Absolut Research GmbH bemüht sich um sorgfältige Beschaffung und Bereitstellung, kann jedoch keine Gewähr für die Richtigkeit, Vollständigkeit oder Genauigkeit der Inhalte leisten.
 © Copyright 2016, Hamburg, Absolut Research GmbH. Alle Rechte vorbehalten.