

Paladin Quant Aktien Global Nachhaltig S (a)

(Auflage als OGAW zum 15. 10. 2019, ISIN DE000A2N68Q2,
Details: <https://paladin-am.com/strategien/paladin-quant/seed-phase/>)
Stichtag: 28. 02. 2020

Paladin Quant GmbH
Hindenburgstr. 42
30175 Hannover

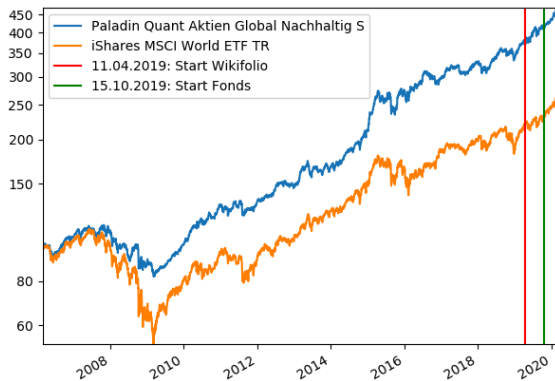
Internet: www.paladin-quant.com
E-Mail: quant@paladin-am.com



BERECHNUNGSMETHODIK (ZEITRAUM: 28.02.06 – 28.02.20)

Die Strategie wurde anhand eines Out-of-Sample-Backtests für den Zeitraum 28. 02. 2006 – 28. 02. 2020 evaluiert. Damit soll eine reale Handelssituation möglichst realitätsnah abgebildet werden. In die simulierten Handelsentscheidungen sind keine Informationen eingeflossen, die zum Simulationszeitpunkt in der Zukunft lagen und somit noch nicht bekannt waren. Es wurden Transaktionskosten von 10bp pro Handelsrichtung sowie Cash-Kosten von 40bp und laufende Gebühren von 60bp unterstellt. Vom 11. 04. 2019 an wurden die Daten eines Wikifolios verwendet, in dem die Strategie nachgebildet wurde und vom 15. 10. 2019 an die Daten des aufgelegten Fonds. Bei der Berechnung der Sharpe-Ratio wurde ein risikoloser Zins von 0% verwendet.

WERTENTWICKLUNG



KENNZAHLEN

	Max	5J	3J	1J	YTD
Rendite p.a.	10.98%	11.66%	11.03%	16.84%	-1.42%
Sharpe Ratio	1.11	1.15	1.28	1.84	0.0
Volatilität p.a.	9.9%	10.1%	8.5%	8.7%	0.0%
Value at Risk (M,95%)	3.7%	3.1%	3.1%	3.0%	0.0%
Beta (iShares MSCI World ETF TR)	0.57	0.66	0.64	0.61	0.0
Max. Drawdown	28.4%	14.4%	8.3%	8.3%	8.3%

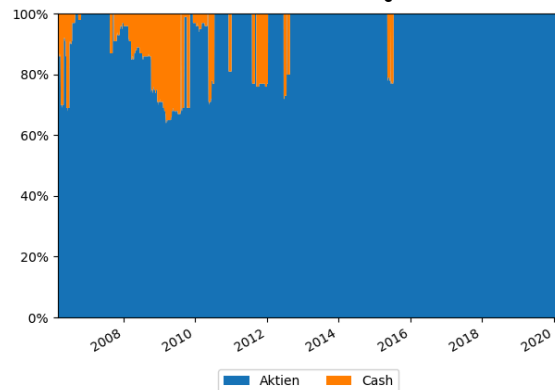
ANLAGESTRATEGIE

Anlageuniversum sind internationale Aktien von Großunternehmen, die durch den Grundsatz der Nachhaltigkeit nach dem Best-in-Class-Prinzip ausgewählt werden. Unternehmen mit kontroversen Aktivitäten werden von vornherein ausgeschlossen. Die Aktienquote beträgt stets zwischen 51% und 100%. Anlageziel ist die Konstruktion eines nachhaltigen, globalen Aktienportfolios, das eine attraktive Rendite erzielt, im Vergleich zum weltweiten Aktienmarkt aber eine niedrigere Volatilität und deutlich geringere Draw-Downs aufweist.

Eine Gewichtung nach Marktkapitalisierung ist meist suboptimal. Wir ermitteln diejenige Portfoliozusammensetzung, die zu einer optimalen Diversifikation führt. Einmal im Monat erfolgt eine Neugewichtung der Aktien. Zusätzlich wird das Portfoliorisiko täglich überwacht. Bei Überschreiten bestimmter Risikoschwellen wird sofort neugewichtet. Die Steuerung der Investitionsquote ist dabei Bestandteil der Optimierung.

Zur Bestimmung der Portfoliogewichte und zur Messung des Portfoliorisikos werden moderne Mustererkennungsverfahren eingesetzt. Im Vergleich zu klassischen Methoden nach Markowitz erlauben diese eine präzisere Risikomessung und Risikosteuerung sowie eine bessere Abbildung der Risiken von Extremereignissen. Zusätzlich werden von Paladin Quant entwickelte Techniken zur robusten Portfoliooptimierung eingesetzt.

HISTORISCHE INVESTITIONSQUOTE



MONATLICHE RENDITEN

	Jan	Feb	Mar	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	Jahr	MDD
2006	-	-	1.07%	-0.65%	-5.0%	0.21%	0.92%	4.18%	2.82%	1.8%	-1.72%	2.64%	6.12%	9.0%
2007	2.57%	-1.37%	2.18%	0.93%	2.41%	-2.12%	-2.08%	-0.35%	3.41%	2.68%	-2.74%	-0.59%	4.76%	9.04%
2008	-6.55%	-0.94%	-3.67%	1.5%	0.4%	-7.09%	0.73%	5.5%	-0.0%	-8.02%	-0.87%	-1.35%	-19.29%	22.78%
2009	0.21%	-4.3%	-1.84%	2.16%	0.99%	1.23%	3.68%	1.39%	2.91%	-0.07%	2.16%	3.68%	12.58%	10.63%
2010	2.65%	3.95%	4.23%	1.62%	1.05%	2.36%	-1.72%	3.71%	-0.05%	0.64%	3.82%	2.91%	28.06%	4.14%
2011	-3.57%	2.67%	-1.08%	1.21%	4.6%	-2.86%	0.52%	-3.63%	1.15%	0.1%	1.1%	3.4%	3.27%	9.19%
2012	0.43%	0.69%	2.57%	0.35%	1.4%	3.46%	3.03%	-0.06%	1.52%	-2.47%	0.7%	-2.13%	9.72%	4.57%
2013	2.24%	6.21%	5.52%	0.15%	-2.92%	-0.5%	1.85%	-2.17%	-0.01%	3.43%	0.62%	-0.76%	14.06%	10.23%
2014	-0.02%	3.05%	1.43%	1.02%	3.68%	1.11%	0.76%	3.62%	2.45%	1.76%	3.45%	1.66%	26.69%	5.45%
2015	11.91%	4.45%	6.71%	-2.12%	1.25%	-2.03%	3.09%	-6.16%	-3.03%	10.15%	4.62%	-1.01%	29.6%	14.36%
2016	-1.92%	2.98%	-0.33%	1.61%	3.42%	3.53%	2.37%	-1.63%	-0.27%	-1.99%	-1.69%	1.97%	8.07%	8.39%
2017	1.36%	4.5%	0.82%	0.17%	0.7%	-2.73%	-1.31%	0.12%	1.18%	2.87%	1.95%	0.43%	10.33%	6.56%
2018	-1.59%	-1.37%	-0.8%	2.12%	3.51%	1.89%	3.76%	1.35%	0.53%	-2.36%	2.78%	-5.72%	3.73%	7.7%
2019	4.78%	3.46%	3.21%	1.75%	-2.11%	4.9%	3.58%	-0.8%	2.89%	-0.06%	2.4%	1.6%	28.5%	5.8%
2020	2.85%	-4.16%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-1.43%	8.3%

LIZENZ-DISCLAIMER, HAFTUNGS-AUSSCHLÜSSERKLÄRUNGEN UND WICHTIGE HINWEISE

Siehe Seite 2 / Rückseite

LIZENZ-DISCLAIMER, HAFTUNGSAUSSCHLUSSERKLÄRUNGEN UND WICHTIGE HINWEISE

Die Informationen richten sich ausschließlich an professionelle Kunden bzw. geeignete Gegenparteien im Sinne des WpHG und sind nicht für Privatkunden bestimmt. Diese Darstellung wird nur zu Informationszwecken und ohne vertragliche oder sonstige Verpflichtung zur Verfügung gestellt. Alle Informationen in dieser Darstellung beruhen auf sorgfältig ausgewählten Quellen, die für zuverlässig erachtet wurden, oder auf eigenen nach bestem Wissen durchgeführten Berechnungen, doch kann die Paladin Quant GmbH deren Richtigkeit, Vollständigkeit oder Genauigkeit nicht garantieren. Jedwede Haftung und Gewähr aus dieser Darstellung wird deshalb vollständig ausgeschlossen.

Alle in der Darstellung geäußerten Meinungen beruhen auf der Einschätzung der Paladin Quant GmbH zum ursprünglichen Zeitpunkt ihrer Veröffentlichung, ganz gleich, wann Sie diese Information erhalten, und können sich ohne Vorankündigung ändern.

Wert und Rendite der dargestellten Fondsprodukte, Wertpapiere und Finanzdienstleistungen können fallen und steigen, und Anleger erhalten unter Umständen nicht den gesamten investierten Betrag zurück. Wertentwicklungen in der Vergangenheit sind kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung. Eine zukünftige Wertentwicklung wird weder ausdrücklich noch implizit garantiert oder zugesagt. Die Berechnung der Wertentwicklung von Fondsprodukten erfolgt nach der BVI-Methode, Simulationen erfolgen in der Regel auf Basis historischer Renditen. Ausgabeaufschläge und individuelle Kosten wie Gebühren, Provisionen und andere Entgelte sind unter Umständen in dieser Darstellung nicht berücksichtigt und würden sich bei Berücksichtigung negativ auf die Wertentwicklung auswirken.

Die Weitergabe aller Unterlagen, Manuskripte, der Präsentationsschrift im Ganzen oder in einzelnen Teilen sowie eine Veröffentlichung, Vervielfältigung, Verbreitung, Nachbildung oder sonstige Verwertung der präsentierten Konzepte, Lösungen und Ideen ist ohne vorherige Zustimmung der Paladin Quant GmbH nicht zulässig.

Die Paladin Quant GmbH ist als Anlageberater (Fondsadvisor) der Ampega Investment GmbH gem. §1 Abs. 1a Satz 2 Nr. 1a KWG ausschließlich auf Rechnung und unter der Haftung der NFS Netfonds Financial Service GmbH (NFS), Heidenkampsweg 73, 20097 Hamburg tätig.

Der Inhalt dieser Präsentation beinhaltet keine persönlichen Empfehlungen und stellt daher keine Anlageberatung dar.