

■ MANAGEMENT:

Invest-Design Vermögensverwaltung GmbH

■ ANLAGESTRATEGIE:

Die **ACTIVE+** Strategie verfolgt eine Absolute-Return-Strategie, wodurch bei steigenden als auch bei stagnierenden oder kontinuierlich fallenden Märkten positive Ergebnisse erzielt werden sollen. Auf Basis des Anfangsinvestments werden durch kurzfristiges Option-Trading auf historisch grundsätzlich stabile Indizes monatliche Returns erzielt. Bei diesen Optionspositionen handelt es sich ausschließlich um Kontrakte auf Aktienindizes, welche über eine Terminbörse gehandelt werden. Sämtliche Positionen werden aufgrund des am Institut für Finanzmathematik und Angewandte Zahlentheorie entwickelten mathematischen Ansatzes eingegangen und mithilfe entsprechender Analyse-Programme überwacht.

■ ECKDATEN:

Laufzeit: alle 8 Wochen kündbar oder erweiterbar
 Mindestinvestment: EUR 50.000,--
 Investitionsgrad: vorwiegend 50 – 100% des Gesamtinvestments (reiner Optionshandel)
 Risiko: hochspekulativ, Totalverlust möglich, aktives Risiko-Management
 Transparenz: klarer und transparenter Strategieansatz
 Monitoring: Einsatz modernster finanzmathematischer Analysemethoden
 Berichte: regelmäßiger Performancebericht

■ PERFORMANCE **ACTIVE+** (zur Veranschaulichung der Verlustmonate):¹⁾

	Jän.	Feb.	Mär.	Apr.	Mai	Jun.	Jul.	Aug.	Sep.	Okt.	Nov.	Dez.	ACTIVE+ ²⁾	S&P 500
													p.a.	p.a.
2009	2,21%	2,04%	2,66%	0,63%	0,73%	1,17%	0,84%	0,43%	1,15%	1,35%	0,72%	1,38%	16,40%	24,17%
2010	1,79%	0,66%	0,79%	1,19%	-8,40%	2,68%	0,92%	1,44%	1,35%	1,08%	1,67%	1,35%	6,22%	12,83%
2011	0,90%	0,95%	1,37%	0,49%	0,86%	1,13%	1,89%	-21,47%	0,00%	2,04%	1,36%	2,89%	-9,88%	-1,95%
2012	1,31%	0,91%	1,03%	1,03%	1,12%	1,22%	0,00%	0,78%	1,29%	1,96%	0,00%	1,13%	12,42%	17,26%
2013	1,60%	0,73%	0,90%	1,31%	1,58%	1,21%	1,91%	0,00%	1,38%	0,89%	0,00%	0,54%	12,72%	27,14%
2014	0,65%	0,94%	1,00%	0,89%	1,08%	0,42%	0,70%	0,91%	0,96%	-19,88%	0,76%	0,44%	-12,58%	13,88%
2015	0,91%	1,71%	0,71%	0,91%	1,03%	1,19%	0,96%	0,85%	1,66%	0,92%	0,72%	0,80%	13,09%	-3,14%
2016	1,67%	0,75%	0,71%	0,96%	0,17%	1,25%	0,51%	0,55%	0,69%	1,00%	0,63%	0,63%	9,94%	12,59%
2017	0,67%	0,53%	0,36%	1,01%	1,05%	0,69%	0,71%	0,62%	1,55%	0,72%	0,96%	0,72%	10,02%	18,50%
2018	0,69%	-21,18%	1,68%	2,21%	1,12%	0,00%	1,50%	0,00%	1,48%				-14,09%	8,90%

■ KENNZAHLEN:¹⁾

	ACTIVE+	S&P 500
Performance gesamt	45,03%	228,20%
Performance p.a.	3,89%	12,96%
Volatilität p.a.	12,48%	13,95%
Sharpe-Ratio modified	0,31	0,93
Korrelation MSCI WORLD (EUR)	0,37	0,86



Quelle: Bloomberg, Invest-Design

1) Die Performancezahlen verstehen sich nach Abzug der Transaktions- und Verwaltungskosten. Für die S&P 500 Daten wurde jeweils der Kurs vom entsprechenden Verfalltag der Optionen herangezogen. Die Monatsergebnisse zeigen den Durchschnittsertrag der Kundendepots im jeweiligen Monat. Ab Jan 2014 wurde bei der Performance-Berechnung eine Gewinnbeteiligung berücksichtigt.

2) Derzeit wird die Strategie mehrfach ausschließlich mit Ein- bzw. Zweimonats-Optionen auf den S&P500 gehandelt.

■ RISIKOHINWEIS:

Alle dargestellten Daten beziehen sich auf die Vergangenheit und lassen keine Rückschlüsse auf die künftige Entwicklung zu. Das vorliegende Dokument stellt keine Aufforderung zum Kauf dar. Das Angebot zum Kauf bzw. Verkauf unterbleibt gegenüber Personen denen derartige Tätigkeiten verboten sind. Die verwendete Strategie ist hochspekulativ und sollte nur von erfahrenen und umsichtigen Investoren ins Auge gefasst werden. Die Renditen aus dieser Veranlagung können sowohl steigen als auch fallen. Wiederholte monatliche Verluste sind ein Strategiebestandteil. **Ein hoher, bis zum Totalverlust** des gesamten investierten Kapitals reichender Verlust kann (insbesondere unter extremen Marktbedingungen) **nicht ausgeschlossen** werden. Für die angeführten Angaben wird keinerlei Haftung übernommen, etwaige Druckfehler sind vorbehalten.