

Managed Account EXCLUSIVE 2M

Erstellungsdatum: 24.10.2018
Oktober 2018

■ MANAGEMENT:

Invest-Design Vermögensverwaltung GmbH

■ ANLAGESTRATEGIE:

Die **EXCLUSIVE 2M** 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 Optionen mit zumeist 2 Monaten Restlaufzeit auf historisch grundsätzlich stabile Indizes monatliche Returns erzielt. Dazu wird die Hälfte des Investments jeden Monat erneuert. 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 60.000,--

Investitionsgrad: vorwiegend 50 – 100 % des Gesamtinvestments (reiner Optionenhandel)

Risiko: hochspekulativ, Totalverlust möglich, aktives Risiko-Management

Transparenz: klarer und transparenter Strategieansatz

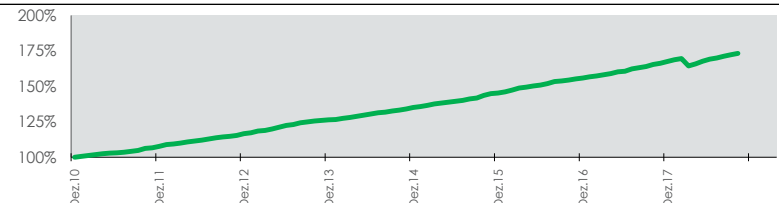
Monitoring: Einsatz modernster finanzmathematischer Analysemethoden

Berichte: regelmäßiger Performancebericht

■ PERFORMANCE EXCLUSIVE 2M (zur Veranschaulichung der Verlustmonate):¹⁾

	Jän.	Feb.	Mär.	Apr.	Mai	Jun.	Jul.	Aug.	Sep.	Okt.	Nov.	Dez.	2M ²⁾	S&P 500
													p.a.	p.a.
2011	0,71%	0,65%	0,56%	0,48%	0,54%	0,20%	0,38%	0,51%	0,69%	1,29%	0,50%	1,01%	7,77%	-1,95%
2012	1,12%	0,44%	0,47%	0,78%	0,51%	0,56%	0,85%	0,59%	0,64%	0,31%	0,66%	0,92%	8,14%	17,26%
2013	0,53%	1,09%	0,38%	0,94%	1,06%	1,02%	0,49%	1,04%	0,35%	0,52%	0,43%	0,23%	8,38%	27,14%
2014	0,30%	0,53%	0,54%	0,62%	0,60%	0,65%	0,76%	0,29%	0,58%	0,42%	0,76%	0,68%	6,94%	13,88%
2015	0,43%	0,68%	0,76%	0,47%	0,47%	0,47%	0,41%	0,63%	0,56%	1,22%	0,90%	0,35%	7,60%	-3,14%
2016	0,49%	0,93%	0,94%	0,49%	0,53%	0,35%	0,71%	0,97%	0,32%	0,34%	0,60%	0,36%	7,26%	12,59%
2017	0,51%	0,36%	0,55%	0,57%	0,73%	0,34%	0,98%	0,54%	0,52%	0,84%	0,58%	0,75%	7,51%	18,50%
2018	0,70%	0,48%	-3,04%	0,89%	1,06%	0,88%	0,57%	0,62%	0,61%	0,60%			3,35%	3,44%

■ KENNZAHLEN:¹⁾

	2M	S&P 500	EXCLUSIVE 2M S&P 500 Index
Performance gesamt	73,22%	122,51%	
Performance p.a.	7,27%	10,75%	
Volatilität p.a.	1,54%	12,79%	
Sharpe-Ratio modified	4,73	0,84	
Korrelation MSCI WORLD (EUR)	0,11	0,87	
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.

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. **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.