

Musterdepot / Kerninvestments Family Offices

18.01.2023

Basisinformationen

Startdatum

01.01.2013

Beschreibung

Das Musterdepot bildet die Kerninvestments von Family Offices (nach "Stewardship & Purpose - conversation with the world's wealthiest families", J.P. Morgan Private Bank. Daten von November 2022) gleichgewichtet ab: 1/3 (Bio-)Technologie, 1/3 Healthcare, 1/3 Immobilien

Kenntnisse & Erfahrungen

Basiskonntnisse

Durchschnitts-SRRI

4,85

Anlagehorizont

mehr als 10
Jahre

Höchste SRRI

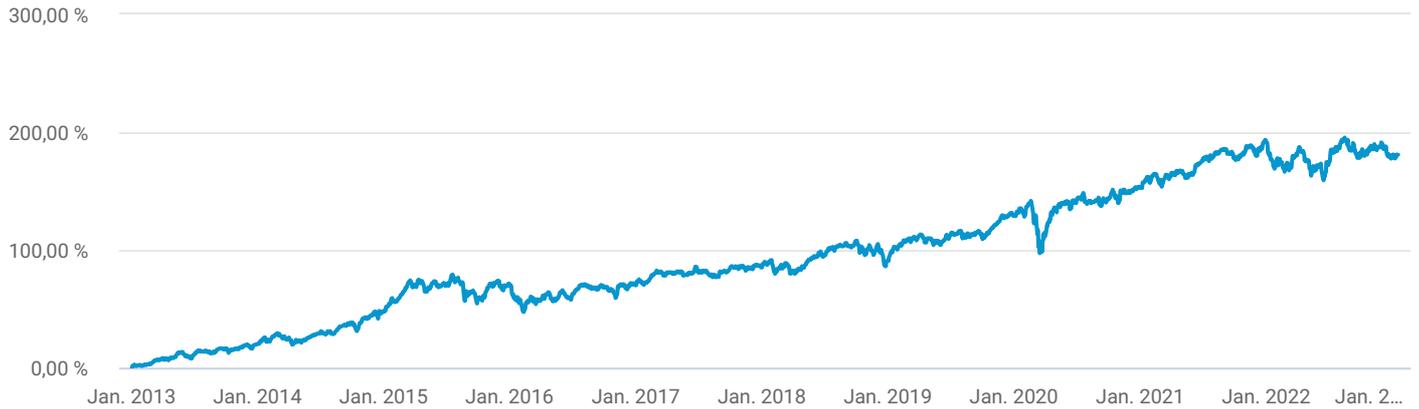
7

Instrumente

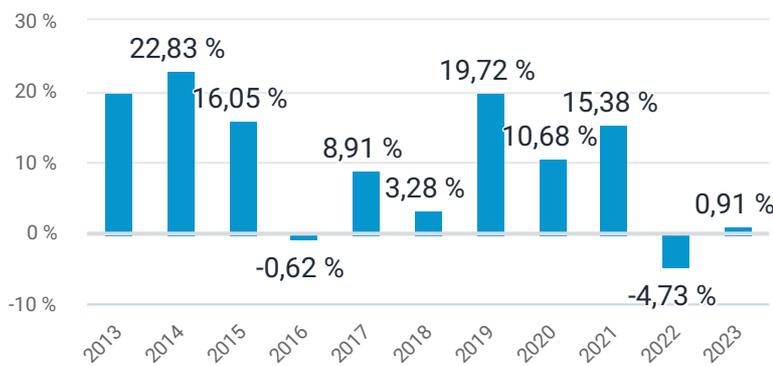
Instrumentenname ISIN/WKN	SRRI	Rendite lfd. Jahr	Rendite s. Auflage p.a.	Rendite 1J	Rendite 3J p.a.	Rendite 5J p.a.	ESG Score U	ESG Score S	Sharpe Ratio	MWV	Gewichtung
AB SICAV I-International Health Care Portfolio Class A EUR Acc LU0251853072 / A0JMHJ	6	-0,74 %	4,53 % 05.01.1999	1,93 %	10,34 %	12,25 %	20,96 / 50	- / 50	0,53	-25,76 %	33,00 %
DNB Fund - Technology Retail A (EUR) LU0302296495 / A0MWAN	6	5,33 %	14,12 % 16.08.2007	-10,97 %	7,81 %	11,98 %	17,00 / 50	- / 50	0,43	-33,32 %	17,00 %
grundbesitz global RC DE0009807057 / 980705	2	0,13 %	3,24 % 25.07.2000	2,07 %	2,04 %	2,42 %	- / 50	- / 50	2,46	-0,93 %	33,00 %
Pictet-Biotech P EUR LU0255977455 / A0J4DP	7	0,83 %	8,76 % 14.06.2006	7,15 %	0,51 %	4,26 %	29,30 / 50	13,09 / 50	0,16	-37,42 %	17,00 %

Wertentwicklung

● Kerninvestments Family Offices



Jährliche Wertentwicklung in %



Wertentwicklung in %

Zeitgewichtete Methode

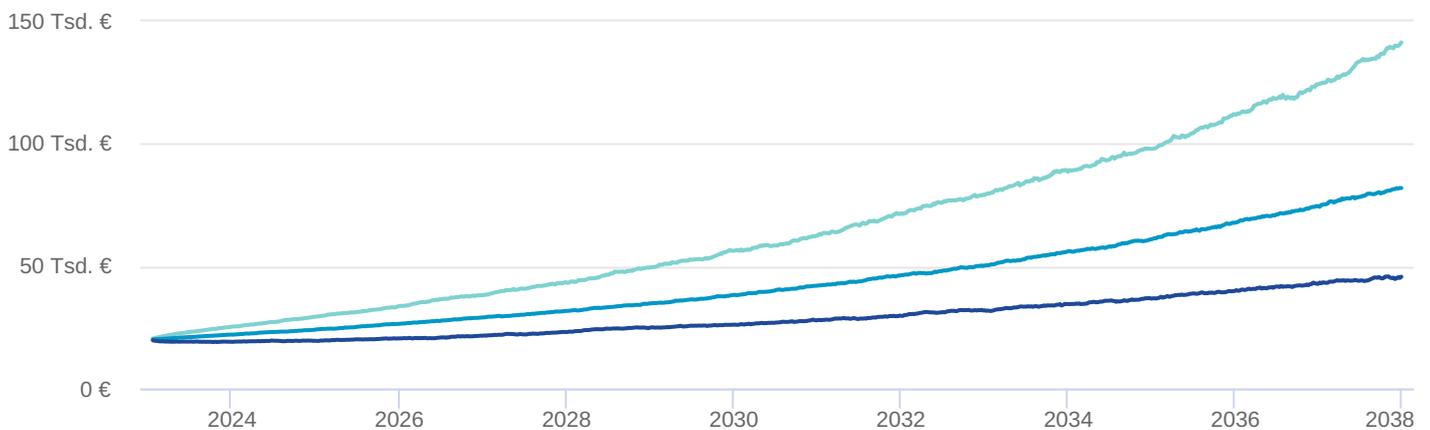
	Annualisiert	Kumuliert
1 Monat	-	0,40 %
3 Monate	-	-0,73 %
6 Monate	-	-1,31 %
Lfd. Jahr	-	0,93 %
1 Jahr	-	1,49 %
3 Jahre	6,08 %	19,38 %
5 Jahre	8,30 %	48,99 %
10 Jahre	10,71 %	176,61 %
Seit Auflage am 01.01.2013	10,95 %	184,32 %

Mögliche Wertentwicklung 15 Jahre

Insgesamt eingezahlt **20,00 Tsd. EUR**

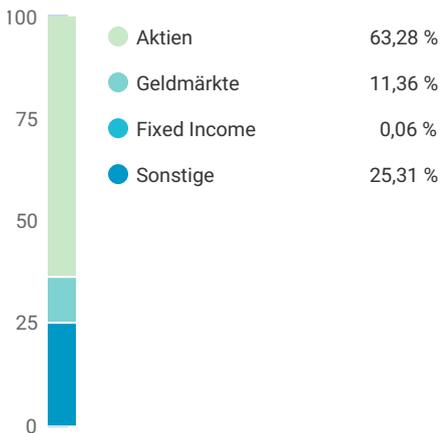
- Starke Wertentwicklung: **141,41 Tsd. EUR** (13,93 % p.a.)
- Durchschnittliche Wertentwicklung: **81,90 Tsd. EUR** (9,85 % p.a.)
- Schlechte Wertentwicklung: **45,69 Tsd. EUR** (5,66 % p.a.)

Depot- und Transaktionskosten (wie z.B. Ausgabeaufschlag) sind in der Berechnung nicht berücksichtigt

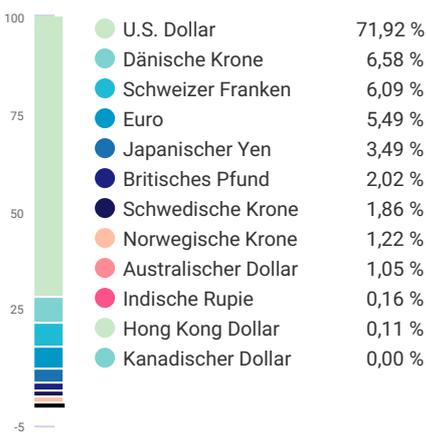


Portfoliostruktur

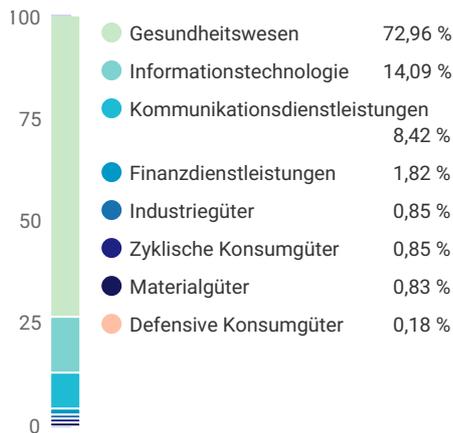
Assetklassen



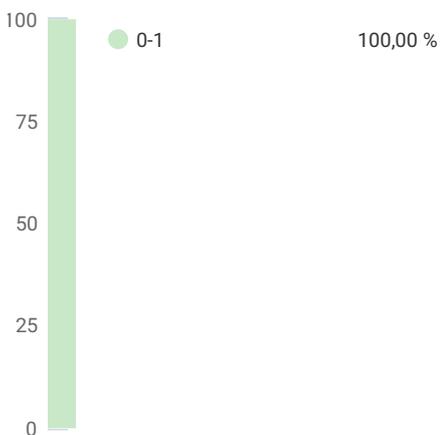
Währungen



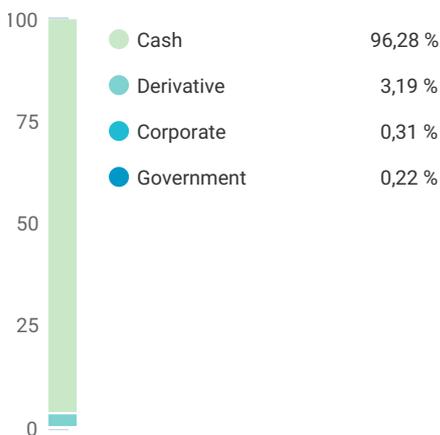
Branchen



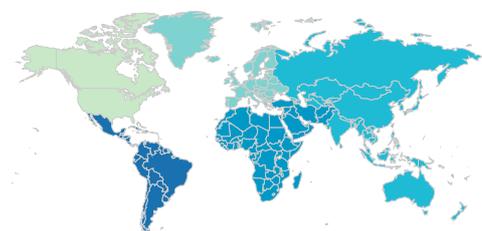
Restlaufzeiten



Emittentenstruktur



Regionen



Top 10 Instrumente

Mehrheitsbeteiligungen	11,68 %
Geschäftsgrundstücke	9,15 %
UnitedHealth Group, Inc.	3,01 %
Novo Nordisk A/S - Class B	2,29 %
Minderheitsbeteiligungen	2,28 %
Roche Holding AG	2,20 %
Amgen, Inc.	1,87 %
Elevance Health, Inc.	1,82 %
Microsoft Corp	1,66 %
Vertex Pharmaceuticals, Inc.	1,60 %

Kennzahlen

Expected Shortfall	Sharpe Ratio	Tracking Error	Information Ratio	Alpha
24,20 %	0,95 Benchmark -	Keine Benchmark gesetzt	Keine Benchmark gesetzt	Keine Benchmark gesetzt
Beta	Rendite	Rendite p.a.		
Keine Benchmark gesetzt	180,90 %	10,82 %		

Historischer Value at Risk (VaR) ¹



Volatilität ²



Maximaler Wertverlust ³



¹ Der Value at Risk ist eine Kennzahl bzw. eine darauf gestützte Methode zur Quantifizierung, insbesondere der Markt- und Preisrisiken von Kassa- oder derivativen (Finanz-)Instrumenten, sowie Adressausfallrisiken bei Kreditinstrumenten.

² Die Volatilität misst die Intensität der Schwankungen eines Fonds innerhalb eines Jahres um den eigenen Mittelwert.

³ Der Maximaler Verlust ist eine Kennzahl, die den größten prozentualen Wertverlust eines Fonds innerhalb eines bestimmten Zeitraums angibt. Der Wert entspricht der Rendite vom teuersten Kurs zum billigsten Kurs im betrachteten Zeitintervall.

Zeitraum der Wertaufholung: 95 Tage

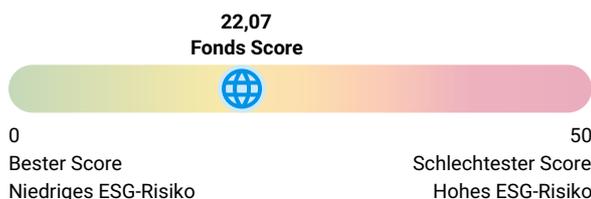
Datum des maximalen Wertverlust 16.03.2020

Erholungsdatum 19.06.2020

[Portfolio](#)

Nachhaltigkeitsanalyse (ESG)

Morningstar Historischer Sustainability Score (Unternehmen) ⁴



Morningstar Historischer Sustainability Score (Staaten) ⁴



ESG-Pfeiler ⁵

Umwelt	1,42
Soziales	10,18
Governance	6,69

⁴ Der historische Morningstar Nachhaltigkeits-Score ist ein gewichteter Durchschnitt der letzten 12 Monate der Morningstar Portfolio Nachhaltigkeits-Scores. Es wird nach Risiken für Unternehmen und Risiken für Staaten differenziert. Die Scores der beiden Unterrisiken werden dann zu einem Gesamtscore zusammengeführt. Hierbei werden die Scores aus der jüngeren Vergangenheit stärker gewichtet als ältere Scores des 12-Monats-Zeitraums. Basierend auf dem Historischen Morningstar Nachhaltigkeits-Score werden den Fonds absolute Kategorien und prozentuale Ränge innerhalb der Morningstar Global Categories zugewiesen. Das bedeutet, dass durch den Ausweis absoluter Zahlen ein Fonds auch über Fondskategorien bzw. Vergleichsgruppen hinweg vergleichbar wird.

⁵ Umwelt: Der nach Vermögenswerten gewichtete Durchschnitt des Unternehmens-Umweltrisiko-Scores für die abgedeckten Bestände in einem Portfolio. Die Umweltrisiko-Scores von Sustainalytics messen das Ausmaß, in dem der wirtschaftliche Wert eines Unternehmens durch Umweltfaktoren gefährdet sein kann. Das Umweltrisiko stellt das nicht gemanagte Umweltrisiko dar, nachdem das Management solcher Risiken durch ein Unternehmen berücksichtigt wurde. Die Umweltrisiko-Scores werden als Zahl zwischen 0 und 100 angezeigt, wobei die meisten Scores zwischen 0 und 25 liegen.

Soziales: Der vermögenswertgewichtete Durchschnitt des Company Social Risk Scores für die abgedeckten Bestände in einem Portfolio. Company Social Risk Scores von Sustainalytics messen das Ausmaß, in dem der wirtschaftliche Wert eines Unternehmens durch soziale Faktoren gefährdet sein kann. Das soziale Risiko stellt das nicht gemanagte soziale Risiko dar, nachdem das Management solcher Risiken durch ein Unternehmen berücksichtigt wurde. Die Social Risk Scores werden als Zahlen zwischen 0 und 100 angezeigt, wobei die meisten Scores zwischen 0 und 25 liegen.

Governance: Der nach Vermögenswerten gewichtete Durchschnitt des Unternehmens-Governance-Risiko-Scores für die abgedeckten Bestände eines Portfolios. Die Unternehmens-Governance-Risiko-Scores von Sustainalytics messen das Ausmaß, in dem der wirtschaftliche Wert eines Unternehmens aufgrund von Governance-Faktoren gefährdet sein kann. Das Governance-Risiko stellt das nicht gemanagte Governance-Risiko dar, nachdem das Management solcher Risiken durch ein Unternehmen berücksichtigt wurde. Die Governance-Risiko-Scores werden als Zahl zwischen 0 und 100 angezeigt, wobei die meisten Scores zwischen 0 und 25 liegen.

RECHTLICHE HINWEISE

Eine positive Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein verlässlicher Indikator für eine zukünftige positive Wertentwicklung. Anleger erhalten daher unter Umständen nicht den investierten Betrag vollständig zurück. Dies kann bis zu einem Totalverlust des investierten Betrages reichen.

Die in diesem Dokument enthaltenen Informationen wurden sorgfältig ausgewählt und geprüft. Eine Gewähr für die Richtigkeit kann jedoch nicht gegeben werden.

Der Inhalt des Dokuments stellt weder eine individuelle Anlageempfehlung noch eine Einladung zur Zeichnung oder ein Angebot zum Kauf bzw. Verkauf von Anteilen der genannten Investmentfonds(-klassen) bzw. ein Angebot zum Abschluss der dargestellten Anlageprodukte oder Portfolioverwaltung dar. Das Dokument ersetzt keine sorgfältige Beratung durch einen kompetenten Berater. Alleinige Grundlage für eine Anlageentscheidung für Investmentfonds sind die Verkaufsunterlagen, das heißt der jeweilige Verkaufsprospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen, der aktuelle Jahresbericht sowie der aktuelle Halbjahresbericht.