# **Risk Managed Fund 12**



#### Anlagestrategie

Erwirtschaftung kontinuierlicher Ertraege durch Anlage in ein diversifiziertes Portfolio. Auf Basis regelgebundener Ansaetze werden die renditetreibenden Rahmendaten (Konjunkturdaten, Bewertungsdaten, Risikoaversion etc.) systematisch ausgewertet, um dann Renditeprognosen für verschiedene Maerkte abzuleiten. Diese Ergebnisse werden mit Ueberlegungen der Volkswirte von M.M. Warburg abgeglichen (sog. reality check), um daraus schliesslich eine taktische Allokation abzuleiten, die zu einem gegebenen Zeitpunkt deutlich von der strategischen Allokation abweichen kann. Mittels einer aktiven Risikosteuerung wird eine Volatilitaet von 12% angestrebt.

# Chart - Wertentwicklung

Time Period: 31.05.2013 to 28.02.2018



#### Disclaimer

Discalimer
Morningstar stellt ausschließlich Produktinformationen zur Verfügung, die weder eine Anlageberatung noch eine Produktempfehlung darstellen. Es gelten die unter www.morningstar.de erhältlichen Nutzungsbedingungen. Es wird keine Haftung für die Vollständigkeit, inhaltliche Richtigkeit und Aktualität der Informationen übernommen. Die in der Vergangenheit erzielten Erfolge sind keine Garantie für die zukünftige Entwicklung. Die Berechnungen der Wertentwicklung erfolgen ohne Berücksichtigung eines Ausgabeaufschlags bzw. Rücknahmeabschlags und unter der Annahme der Peinvertitien aller Ausschüttungen. Reinvestition aller Ausschüttungen.

#### -Risk Managed Fund 12

### -EAA Fund EUR Moderate Allocation - Global

	1 Monat	3 Monate	6 Monate	YTD	Start
Risk Managed Fund 12	-2.38	-0.24	3.74	-0.69	23.82
EAA Fund EUR Moderate Allocation - Global	-1.58	-0.41	1.75	-0.66	18.49

# Vermögensaufteilung

Portfolio - Anlagestil

Giant



0

Regionale Aufteilung		
Portfolio Date: 28.02.2018		
Americas %	27.09	
Greater Europe %	57.20	
Greater Asia %	15.71	

Die grossten Positionen	III 70
USTREAS T-Bill Auction Av	4.89
Physical Gold	0.79
Total SA	0.53
Deutsche Post AG	0.50
Faurecia SA	0.46
UPM-Kymmene Oyj	0.42
Covestro AG	0.40
Novartis AG	0.38
LVMH Moet Hennessy Loui	0.36
RMP Parihas	በ 35

### Aktien - Anlagestil

Portfolio Date: 28.02.2018 Morningstar Equity Style Box™

Portfolio Date: 28.02.2018 ningstar Fixed Income Style Box"

Portfolio Date: 28.02.2018

AAA %

AA %

BBB %

BB %

B %

B %

Not Rated %

Α%

				arge
				Mid
				Small
Ì	Value	Blend	Growth	
	Anle	ihen -	Anla	gestil

market oap	/0
Market Cap Giant	31.2
Market Cap Large	34.0
Market Cap Mid	30.6
Market Cap Small	3.3
Market Cap Micro	0.9

**Fixed-Income Stats** 

6.3 8

Sektorengewichtung	
Portfolio Date: 28.02.2018	
Basic Materials %	8.46
Consumer Cyclical %	16.44
Financial Services %	14.39
Real Estate %	2.44
Consumer Defensive %	7.94
Healthcare %	11.29
Utilities %	3.16
Communication Services %	4.40
Energy %	5.13
Industrials %	15.52
Technology %	10.83

# Stammdaten

Asset Manager: Warburg Invest KAG mbH Verwaltungsgesellschaft: Warburg Invest KAG mbH Domizil: Fürstentum Liechtenstein UCITS: Nein Ertragsverwendung: Thesaurierend Interne Fund ID: CL009 Management Fee: 1.90% Performance Fee: No NAV zum 28.02.2018: 61.91

## Hig Average Eff Duration

			•		
		Med	Average Eff Maturity	8.8	
			Average Coupon	3.1	
Low	Average Price	-			
Ltd	Mod Ext		Average Credit Quality	BBB	
Bon	Bonitaet				

# Portfolio - Kennziffern

Time Period: 01.06.2013 to 28.02.2018

	11110 1 01100. 01.00.2010 to 20	.02.2010		
9.05	Source Data: Monthly Return			
21.16		Inv	Bmk1	
7.92	Return	23.82	18.49	
58.71	Std Dev	6.98	5.25	
3.06	Sharpe Ratio	0.69	0.72	
0.00	Information Ratio (arith)	0.34		
0.00	Max Drawdown	-9.28	-8.04	
0.11	Worst Month	-5.02	-3.86	

Source: Morningstar Direct