

AMETOS ETF-STRATEGIE

„Börse ist Psychologie plus Disziplin“



Woran scheitern die meisten Vermögensverwaltungsprodukte?

Die Versuche, durch ein aktives Management „den Markt“ zu schlagen, scheitern in der Regel an falschen Timing-Entscheidungen, unglücklichem „Stock-Picking“ und hohen Kosten. Erfolgreiche Ausnahmen wie ‚Quantmade‘ und ‚Aquantum‘, die wir zur Risikoreduzierung unserer Portfolios einsetzen, bestätigen die Regel.

Wir haben eine gute Lösung für das Basisportfolio unserer Kunden!

Einsatz passiver Fonds, Verzicht auf Market-Timing, geringe Umschichtungshäufigkeit – dadurch niedrige Kosten auf allen Ebenen sowie eine starke Reduzierung von Timing-Fehlern und Fehlern beim „Stock-Picking“.

Die besonderen Vorteile auf einen Blick:

Niedrige Kosten

Hohe Liquidität

Massgeschneiderte Asset-Allocation

Wenige Umschichtungen

Vermeidung von Timing-Fehlern

Antizyklisches Investieren

Einfache Handhabung

Unbegrenzt skalierbar

Transparent

AMETOS INVEST GMBH
Bockenheimer Landstraße 101
D-60325 Frankfurt
Telefon 069 – 97 57 07 -0
Telefax 069 - 74 05 50
Geschäftsführer: Dirk Schaper,
Johannes Gerlinger
HRB Frankfurt Nr. 87731
BaFin-ID: 10121645
info@ametos-invest.de
www.ametos-invest.de

Globale Vermögensallokation des Basisportfolios mit ETFs:

Die **Ametos-ETF-Strategie** basiert auf einem passiven Asset-Management-Ansatz und kann dem Kunden in der Regel in jedem Jahr eine Ersparnis von 0,5% – 2% an Kosten gegenüber aktiven Management-Konzepten bringen, was seinem Nettoergebnis zu Gute kommt. Umschichtungen erfolgen nur selten, sowohl auf Ebene der Fonds als auch in den Kundenportfolios.

Der entscheidende erste Schritt: die richtige Asset Allocation. Denn die Erfahrung zeigt: Die Auswahl und Gewichtung der Asset-Klassen, Branchen und Regionen hat weit mehr Auswirkung auf den Erfolg als der ständige Versuch, die Schwankungen der Märkte durch eine Vielzahl von Käufen und Verkäufen auszunutzen. Für den Kunden wird daher auf Basis seines Risikoprofils eine maßgeschneiderte Asset-Allokation (Aktien, Renten, Cash, Regionen, Sektoren, etc.) festgelegt, die dann sehr günstig implementiert und langfristig eingehalten werden soll.

Die ausgewählten Märkte werden sodann durch passiv verwaltete Fonds, wie z.B. ETFs

(„Exchange Traded Funds“) abgedeckt, wobei in der Regel klassische ETFs zum Einsatz kommen, die bekannte Indizes abbilden.

Da ein „Rebalancing“ in den Kundenportfolios in der Regel nur ein oder zwei Mal im Jahr erfolgt, fallen auch auf dieser Ebene nur geringe Umschichtungskosten an. „Rebalancing“ bedeutet in diesem Fall, dass Wertpapiere antizyklisch gehandelt werden und somit tendenziell günstig eingekauft und teuer verkauft werden.

Neben der Reduzierung der Kosten bewirkt dies eines: Das Potential der Märkte, in die man investiert hat, kann voll ausgeschöpft werden. Durch die konsequente Umsetzung des Systems

Gewichtung Portfolio

	5%	15%	15%	20%	15%	15%	10%	5%	100%
	iShares DAX ETF	iShares EUROStoxx ETF	iShares MSCI EM Asia	iShares Core S&P 500 ETF	AAR	Quantmade	XETRA Gold ETF	Cash ETF	Ametos Portfolio
Annualized Return	2,80%	3,16%	0,65%	10,43%	9,75%	11,04%	7,90%	-0,43%	6,61%
Annualized Volatility	19,33%	18,54%	19,28%	17,17%	6,61%	8,93%	12,97%	0,17%	9,59%
Sharpe Ratio	0,14	0,17	0,03	0,61	1,48	1,24	0,61	-2,54	0,69
Sortino Ratio	0,21	0,24	0,05	0,90	5,80	2,20	1,09	-2,41	1,13
Worst Drawdown	-25,6%	-25,3%	-40,2%	-22,9%	-3,0%	-6,4%	-6,4%	-2,5%	-13,9%
Longest Drawdown (in Monaten)	34	21	32	12	7	9	9	60	14
Bester Monat	15,0%	17,0%	18,8%	10,6%	9,2%	6,2%	10,5%	0,2%	6,8%
Schlechtester Monat	-16,5%	-17,2%	-12,5%	-9,8%	-1,6%	-5,2%	-7,4%	-0,2%	-5,5%
% Positiver Monate	51,7%	52,5%	45,9%	63,9%	51,7%	66,7%	49,2%	8,2%	55,0%
Durchschnittl. Monatsrendite	0,23%	0,26%	0,05%	0,83%	0,78%	0,88%	0,64%	-0,04%	0,53%

Disclaimer: „Historische Simulation auf Basis der vergangenen Renditen der einzelnen Portfoliobestandteile“

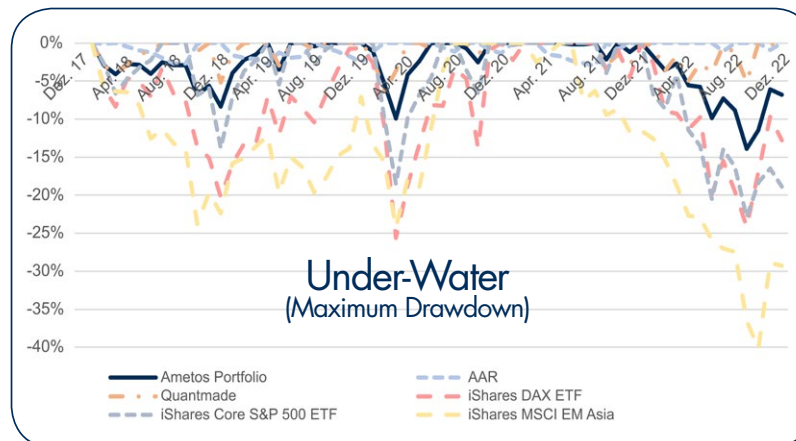
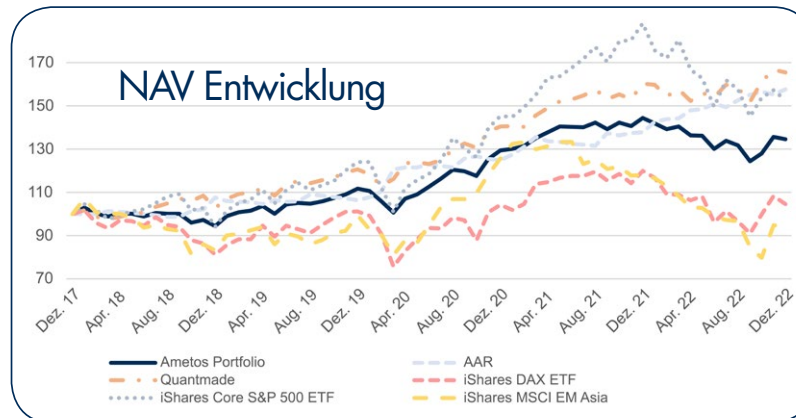
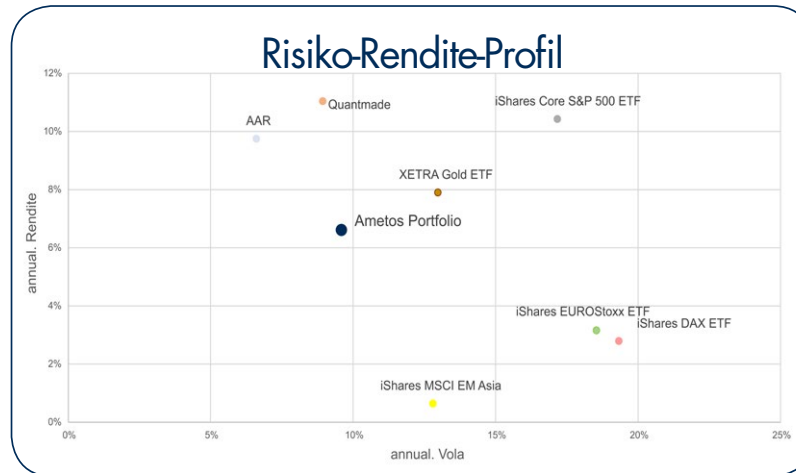
werden psychologisch motivierte falsche Kauf- und Verkaufsentscheidungen (aus ‚Gier‘ oder ‚Angst‘) vermieden.

Die **Ametos-ETF-Strategie** basiert, neben langjährigen eigenen Erfahrungen, auf Analysen und Ausarbeitungen des Nobelpreisträgers Eugene Fama und der Firma Dimensional, einem sehr erfolgreichen US-amerikanischen Asset-Manager und Pionier bei ETF-Strategien. Die Umsetzung kann grundsätzlich über alle Banken und Broker erfolgen, wobei Anbieter mit guten Konditionen und guter Bonität bevorzugt werden sollten.

Risikoreduktion durch Beimischung von Hedge-Strategien und/oder Edelmetallinvestments

Das Portfoliorisiko kann weiter reduziert werden durch die Beimischung von quantitativen Strategien oder Hedgefondstrategien, die nicht, gering oder negativ mit dem Aktienmarkt korrelieren, wie zum Beispiel die Quantmade-Strategie (www.quantmade.com) oder der alternative Investmentfonds ‚Aquantum Active Range‘.

Risikohinweis: Je nachdem, wie Ihre Renditeerwartungen sind und in welche Risikoklasse Sie eingestuft werden, müssen auch bei dieser Strategie Marktschwankungen (z.B. Kurs-, Zins- und Währungsschwankungen) und Verlustrisiken für das Gesamtportfolio in Kauf genommen werden. Die Strategie ist langfristig ausgelegt, wir empfehlen eine Mindest-Haltedauer von 5 Jahren.



- Niedrige Kosten**
- Hohe Liquidität**
- Massgeschneiderte Asset-Allocation**
- Wenige Umschichtungen**
- Vermeidung von Timing-Fehlern**
- Antizyklisches Investieren**
- Einfache Handhabung**
- Unbegrenzt skalierbar**
- Transparent**

AMETOS INVEST GMBH
 Bockenheimer Landstraße 101
 D-60325 Frankfurt
 Telefon 069 - 97 57 07 -0
 Telefax 069 - 74 05 50
 Geschäftsführer: Dirk Schaper,
 Johannes Gerlinger
 HRB Frankfurt Nr. 87731
 BaFin-ID: 10121645
 info@ametos-invest.de
 www.ametos-invest.de