

# Musterportfolio: FFB DSP Sicherheit 11.18

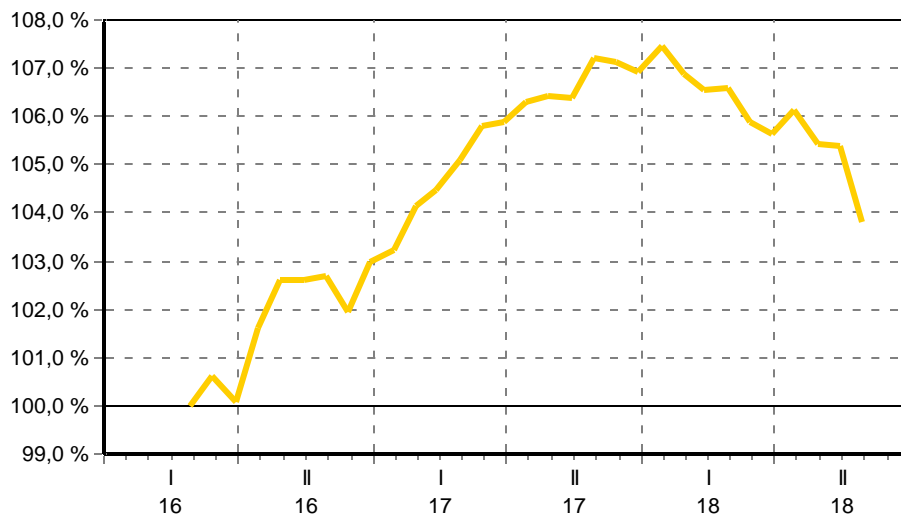
Währung: EUR  
 Beginndatum: 01.05.2016

## Portfolio-Zusammensetzung, am 31.10.2018



- 30,4 % Sauren Global Defensiv A
- 10,1 % AB European Income A2 €
- 10,1 % Argentos Sauren Stabilitäts-Portf.
- 10,0 % Jupiter Dynamic Bond L € Q Inc
- 9,8 % Invesco Glo Targeted Returns A € Adis
- 6,1 % Rücklagenfonds T
- 6,0 % LBBW Multi Global R
- 5,9 % M&G Optimal Income € A-H auss
- 5,8 % Aramea Rendite Plus A
- 5,8 % GAM Star Credit Opport. (EUR) acc

kum. Ergebnis: 104% zum 31.10.2018 (auf EUR-Basis, indiziert auf 100% am 30.04.2016)



### Wertentwicklung p.a. nach BVI auf EUR-Basis, zum 31.10.2018

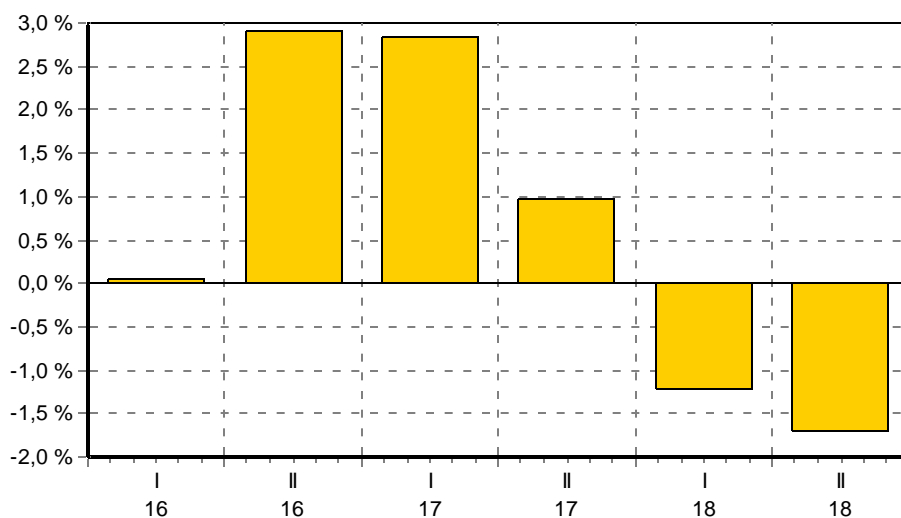
- \* seit 1 Monat: -1,46 %
- \* seit Jahresbeginn: -2,90 %
- seit 1 Jahr: -3,16 %
- seit 2 Jahren: 0,56 %
- seit 3 Jahren: n.v.
- seit 5 Jahren: n.v.
- seit 10 Jahren: n.v.
- seit 15 Jahren: n.v.
- seit 20 Jahren: n.v.

(\* = Veränderung im jew. Zeitraum)

### Volatilität und Sharpe-Ratio

	Volatil.	Sharpe
seit 1 Jahr:	1,76 %	neg.
seit 2 Jahren:	1,99 %	0,24
seit 3 Jahren:	n.v.	n.v.
seit 5 Jahren:	n.v.	n.v.

## Gewinne/Verluste je Zeit-Intervall (auf EUR-Basis)



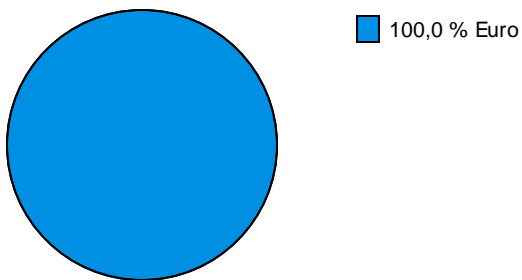
### jährliche Entwicklung nach BVI auf EUR-Basis

- \* im Jahr 2018: -2,90 %
- im Jahr 2017: 3,84 %
- \* im Jahr 2016: n.v.

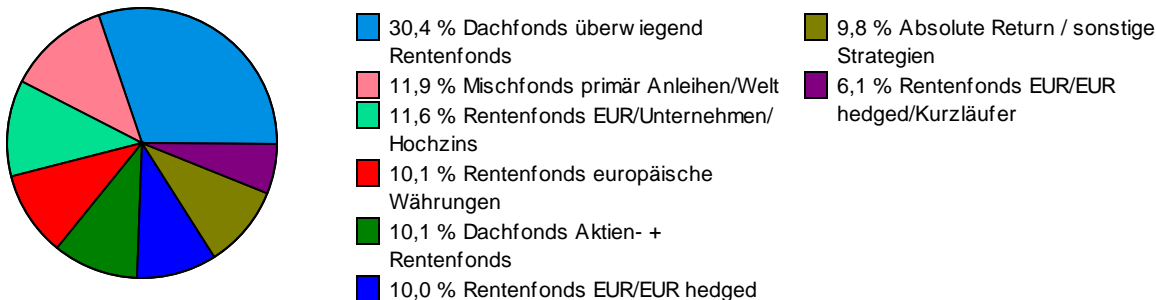
(\* = Jahr nicht vollständig)

# Musterportfolio: FFB DSP Sicherheit 11.18

## Portfoliostruktur nach Fonds-Währungen, am 31.10.2018



## Portfoliostruktur nach Anlagekategorien, am 31.10.2018



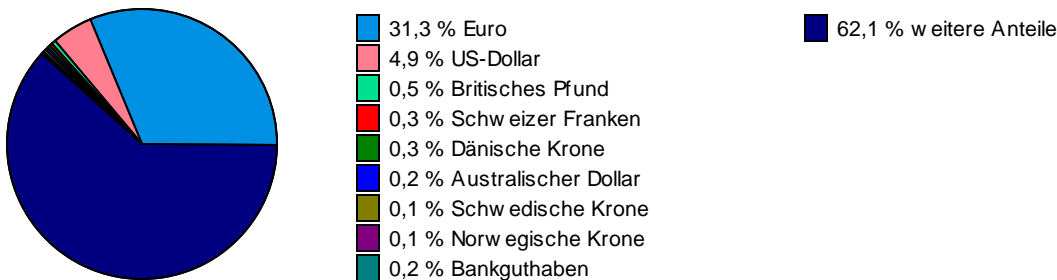
## Portfoliostruktur nach Wertpapieren, am 31.10.2018



## Portfoliostruktur nach Ländern, am 31.10.2018



## Portfoliostruktur nach Währungen, am 31.10.2018



Portfoliostrukturen basieren auf Fondsinformationen mit Stand vom 31.10.2018

# Musterportfolio: FFB DSP Sicherheit 11.18

## Statistik der Portfoliowerte:

Stichtag: 31.10.2018, Basis: EUR

	Portfolio	AB European Income A2 € 989727	Allianz US Short Dur High Income R h2-€ A2AFQE	Aramea Rendite Plus A A0NEKQ	Argentos Sauren Stabilitäts-Portf. DWS0PC
<b>Anteil am Portfolio</b>					
am 01.03.2018	100,0 %	10,0 %	0,0 %	6,0 %	10,0 %
am 31.10.2018	100,0 %	10,1 %	0,0 %	5,8 %	10,1 %
<b>Durchschnittliche Wertentwicklung p.a.</b>	(* = relative Veränderung im jeweiligen Zeitraum)				
*seit 1 Monat	-1,46 %	-0,80 %		-1,64 %	-1,56 %
*seit Jahresbeginn	-2,90 %	-1,64 %		-5,14 %	-2,12 %
1 Jahr	-3,16 %	-2,22 %		-4,57 %	-2,76 %
2 Jahre	0,56 %	0,95 %		2,82 %	-0,34 %
3 Jahre	n.v.	1,91 %		2,94 %	-0,56 %
5 Jahre	n.v.	2,67 %		3,43 %	0,56 %
10 Jahre	n.v.	7,51 %		n.v.	2,08 %
15 Jahre	n.v.	4,48 %		n.v.	n.v.
20 Jahre	n.v.	n.v.		n.v.	n.v.
<b>Volatilität der Wertentwicklung</b>					
1 Jahr	1,76 %	1,97 %		3,33 %	2,14 %
3 Jahre	n.v.	2,86 %		3,88 %	2,07 %
5 Jahre	n.v.	2,99 %		3,73 %	2,09 %
<b>Sharpe-Ratio</b>					
1 Jahr	neg.	neg.		neg.	neg.
3 Jahre	n.v.	0,63		0,73	neg.
5 Jahre	n.v.	0,84		0,88	0,19
	GAM Star Credit Opport. (EUR) acc A1JC54	Invesco Glo Targeted Returns A € Adis A1XCZF	Jupiter Dynamic Bond L € Q Inc A0YC40	LBBW Multi Global R 976688	M&G Optimal Income € A-H auss A1WZWZ
<b>Anteil am Portfolio</b>					
am 01.03.2018	6,0 %	10,0 %	10,0 %	6,0 %	6,0 %
am 31.10.2018	5,8 %	9,8 %	10,0 %	6,0 %	5,9 %
<b>Durchschnittliche Wertentwicklung p.a.</b>	(* = relative Veränderung im jeweiligen Zeitraum)				
*seit 1 Monat	-1,78 %	-2,70 %	-0,58 %	-1,80 %	-2,76 %
*seit Jahresbeginn	-6,01 %	-5,24 %	-4,25 %	-3,31 %	-4,76 %
1 Jahr	-5,80 %	-6,29 %	-4,46 %	-4,00 %	-4,80 %
2 Jahre	3,78 %	-3,10 %	-1,52 %	0,39 %	0,18 %
3 Jahre	4,68 %	-1,76 %	0,02 %	0,72 %	1,99 %
5 Jahre	6,10 %	n.v.	2,05 %	2,23 %	1,94 %
10 Jahre	n.v.	n.v.	n.v.	4,59 %	n.v.
15 Jahre	n.v.	n.v.	n.v.	3,92 %	n.v.
20 Jahre	n.v.	n.v.	n.v.	3,80 %	n.v.
<b>Volatilität der Wertentwicklung</b>					
1 Jahr	4,61 %	3,25 %	1,26 %	2,38 %	3,55 %
3 Jahre	5,19 %	3,52 %	1,85 %	3,32 %	4,02 %
5 Jahre	4,66 %	n.v.	2,25 %	4,18 %	3,42 %
<b>Sharpe-Ratio</b>					
1 Jahr	neg.	neg.	neg.	neg.	neg.
3 Jahre	0,88	neg.	neg.	0,19	0,47
5 Jahre	1,27	n.v.	0,84	0,49	0,52

## Musterportfolio: FFB DSP Sicherheit 11.18

### Statistik der Portfoliowerte:

Stichtag: 31.10.2018, Basis: EUR

	Plenum CAT Bond C € A1XCC2	Rücklagenfonds R A1JRP8	Sauren Global Defensiv A 214466
<b>Anteil am Portfolio</b>			
am 01.03.2018	0,0 %	6,0 %	30,0 %
am 31.10.2018	0,0 %	6,1 %	30,4 %
<b>Durchschnittliche Wertentwicklung p.a.</b>	(* = relative Veränderung im jeweiligen Zeitraum)		
*seit 1 Monat		-0,28 %	-1,35 %
*seit Jahresbeginn		-1,10 %	-0,84 %
1 Jahr		-1,43 %	-1,03 %
2 Jahre		-0,61 %	0,16 %
3 Jahre		0,06 %	-0,43 %
5 Jahre		0,18 %	0,81 %
10 Jahre		n.v.	2,23 %
15 Jahre		n.v.	2,47 %
20 Jahre		n.v.	n.v.
<b>Volatilität der Wertentwicklung</b>			
1 Jahr		0,58 %	1,82 %
3 Jahre		0,89 %	1,92 %
5 Jahre		1,16 %	1,91 %
<b>Sharpe-Ratio</b>			
1 Jahr		neg.	neg.
3 Jahre		neg.	neg.
5 Jahre		0,02	0,34

Alle angegebenen Zahlen zur Wertentwicklung sind ohne Berücksichtigung von Emissionsgebühren und bei Wiederanlage sämtlicher Ausschüttungen berechnet. Grundlage für die Berechnung der Volatilität: Monatliche Returns, logarithmiert, annualisiert. Die Berechnung des Sharpe Ratio beruht auf den zugehörigen Zahlen der Wertentwicklung und der Volatilität.