

Morningstar® Portfolio X-Ray : Modellportfolio - Depotanalyse

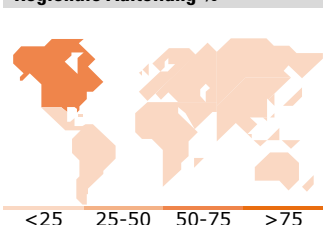
Vermögensaufteilung

	Long	Short	Net
• Aktien	99,89	0,00	99,89
• Anleihen	0,00	0,00	0,00
• Cash	0,11	0,01	0,09
• Sonstige	0,02	0,00	0,02
• Nicht klassifiziert	0,00	0,00	0,00

Top 10 Länder %

Land	Aktien	Land	Aktien
USA	72,22	Schweiz	1,23
Cayman-Inseln	11,75	Dänemark	1,07
Deutschland	2,83	Kanada	1,00
Japan	1,89	Schweden	0,76
Grossbritannien	1,48	China	0,73

Regionale Aufteilung %



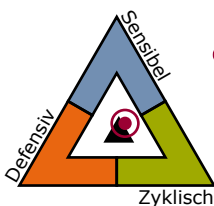
Region	Aktien
Europa	10,67
Großbritannien	1,48
Euroland	5,77
Westeuropa ex Euro	3,29
Schwellenl. Europa	0,00
Afrika	0,13

Region	Aktien
Amerika	85,10
USA	72,22
Kanada	1,00
Lateinamerika	11,88

Region	Aktien
Asien	4,22
Japan	1,89
Australasien	0,60
4 Tiger	0,89
Asien ex- 4 Tiger	0,83

Aktien	0,01
Nicht klassifiziert	0,01

Aktiensektor %



▲ Benchmark
● Portfolio

Sektor	Aktien
Zyklisch	35,95
Rohstoffe	1,11
Konsumgüter zyklisch	31,00
Finanzdienstleistungen	2,61
Immobilien	1,23

Sektor	Aktien
Sensibel	45,54
Telekommunikation	25,53
Energie	0,66
Industriewerte	5,69
Technologie	13,66

Sektor	Aktien
Defensiv	18,50
Konsumgüter n. zykl.	1,06
Gesundheitswesen	14,41
Versorger	3,04

Anlagestil

Größe	Wert	Blend	Wachstum
Groß	3	16	48
Mittel	2	11	8
Klein	2	3	6

Wert Blend Wachstum
Anlagestil
<10 10-25 25-50 >50

Anlagestil	Portfolio
Anlagestil Aktien	
Kurs/Buch	6,23
KGV	34,75
Kurs-Cashflow	25,33

Zinssensibilität	Niedrig	Mittel	Hoch
Hoch Bonität	-	-	-
Mittel Bonität	-	-	-
Niedrig Bonität	-	-	-

Niedrig Mittel Hoch
Zinssensibilität
<10 10-25 25-50 >50

Anlagestil	Portfolio
Anlagestil Anleihen	
Effektive Duration	-
Durchschn. Restlaufzeit	-
Durchschnittliche Bonität	-

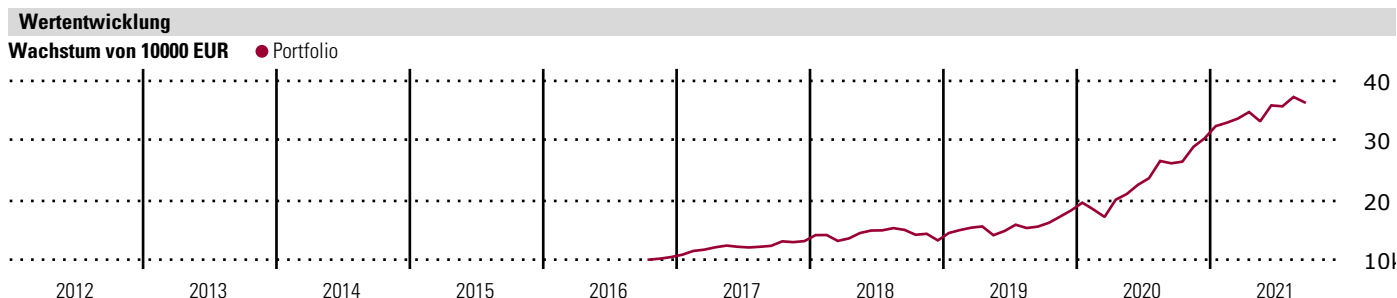
Top 10 der zugrundeliegenden Positionen

Gew. %	Name	Typ	Sektor	Land
19,65	Alphabet Inc Class A	Aktien	Telekommunikation	USA
12,31	Amazon.com Inc	Aktien	Konsumgüter zyklisch	USA
9,54	Tesla Inc	Aktien	Konsumgüter zyklisch	USA
5,81	Skyworks Solutions Inc	Aktien	Technologie	USA
5,41	TRS MSCI World NR USD	Total Return Swap	Nicht klassifiziert	USA
4,87	JD.com Inc ADR	Aktien	Konsumgüter zyklisch	Cayman-Inseln
2,89	Baidu Inc ADR	Aktien	Telekommunikation	Cayman-Inseln
2,34	Keysight Technologies Inc	Aktien	Technologie	USA
2,08	Alibaba Group Holding Ltd ADR	Aktien	Konsumgüter zyklisch	Cayman-Inseln
1,94	SFC Energy AG	Aktien	Industriewerte	Deutschland

Morningstar® Performance X-Ray

Wertentwicklung

30 Sep 2021



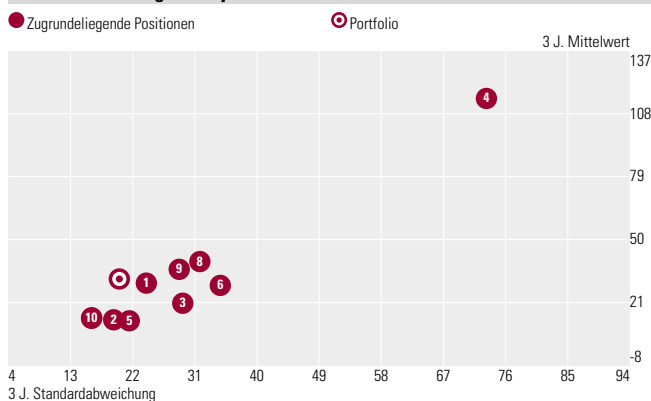
Rollierende Wertentwicklung %

	Portfolio
3 Monate	1,44
6 Monate	8,08
1 Jahr	39,11
3 Jahre p.a.	34,40
5 Jahre p.a.	29,41
lfd.J.	19,91

Rollierende Wertentwicklung %

	Beste	Schlechteste
3 Monate	31,40 (Mrz 20-Jun 20)	-11,76 (Sep 18-Dez 18)
6 Monate	52,42 (Mrz 20-Sep 20)	-11,10 (Jun 18-Dez 18)
1 Jahr	96,20 (Mrz 20-Mrz 21)	-2,58 (Mai 18-Mai 19)
3 Jahre p.a.	36,86 (Apr 18-Apr 21)	13,70 (Mrz 17-Mrz 20)
5 Jahre p.a.	29,41 (Sep 16-Sep 21)	29,41 (Sep 16-Sep 21)

Wertentwicklungs Analyse



Korrelationsmatrix

	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
1	1.00									
2	0.44	1.00								
3	0.42	0.64	1.00							
4	0.28	0.33	0.35	1.00						
5	0.65	0.70	0.46	0.37	1.00					
6	0.38	0.54	0.41	0.30	0.50	1.00				
7	0.67	0.67	0.57	0.42	0.95	0.53	1.00			
8	0.19	0.37	0.36	0.37	0.27	0.46	0.30	1.00		
9	0.22	0.59	0.33	0.51	0.64	0.22	0.56	0.33	1.00	
10	0.67	0.67	0.57	0.41	0.95	0.53	1.00	0.31	0.56	1.00

1.00 To 0.60 0.60 To 0.20 0.20 To -0.20 -0.20 To -0.60 -0.60 To -1.00

Top 10 Positionen

Name	Gewicht %	Mittelwert	Std. Abw.
1 Alphabet Inc Class A	19,61	29,95	23,98
2 iShares Healthcare Innov ETF USD Acc EUR	12,83	13,07	19,25
3 Amazon.com Inc	12,24	20,69	29,25
4 Tesla Inc	9,51	115,01	73,22
5 SPDR® MSCI World Small Cap ETF EUR	8,57	12,60	21,51
6 Skyworks Solutions Inc	5,81	28,91	34,69
7 Xtrackers MSCI World Swap ETF 1C EUR	5,41	14,01	16,07
8 JD.com Inc ADR	4,87	39,88	31,73
9 iShares Global Clean Energy ETF USD Dist EUR	4,63	36,31	28,74
10 iShares MSCI World ETF USD Dist EUR	2,93	13,72	16,04

Statistiken











Risiko und Rendite Statistiken	3 Jahre	5 Jahre
Standardabweichung	20,07	17,00
Mittelwert	31,86	27,46
Sharpe Ratio	1,61	1,64

Überschneidungen

Überschneidungen

Das Portfoliodatum bezieht sich auf den aktuellsten verfügbaren Portfoliobestand in unserer Datenbank. Es kann vorkommen, dass zwei Fonds verschiedene Portfoliodaten haben.

Weitere Informationen finden Sie im letzten Abschnitt "Offenlegung".

Gewichtung im Portfolio (%)	Name	ISIN	Gewichtung der Sektor Holdings (%)	Sektor	Portfoliodatum
19,65	Alphabet Inc Class A	US02079K3059		 Telekommunikation	
0,04	iShares MSCI World ETF USD Dist EUR	IE00B0M62Q58	1,41		13.10.2021
19,61	Alphabet Inc Class A	US02079K3059	100,00		14.10.2021
12,31	Amazon.com Inc	US0231351067		 Konsumgüter zyklisch	
0,07	iShares MSCI World ETF USD Dist EUR	IE00B0M62Q58	2,54		13.10.2021
12,24	Amazon.com Inc	US0231351067	100,00		14.10.2021
9,54	Tesla Inc	US88160R1014		 Konsumgüter zyklisch	
0,03	iShares MSCI World ETF USD Dist EUR	IE00B0M62Q58	1,13		13.10.2021
9,51	Tesla Inc	US88160R1014	100,00		14.10.2021
2,34	Keysight Technologies Inc	US49338L1035		 Technologie	
0,00	iShares MSCI World ETF USD Dist EUR	IE00B0M62Q58	0,05		13.10.2021
2,34	Keysight Technologies Inc	US49338L1035	100,00		14.10.2021
1,26	Apple Inc	US0378331005		 Technologie	
0,12	iShares MSCI World ETF USD Dist EUR	IE00B0M62Q58	4,00		13.10.2021
1,14	Apple Inc	US0378331005	100,00		14.10.2021
0,37	Vestas Wind Systems A/S	DK0061539921		 Industriewerte	
0,00	iShares MSCI World ETF USD Dist EUR	IE00B0M62Q58	0,06		13.10.2021
0,37	iShares Global Clean Energy ETF USD Dist EUR	IE00B1XNHC34	7,92		13.10.2021
0,32	Orsted A/S	DK0060094928		 Versorger	
0,00	iShares MSCI World ETF USD Dist EUR	IE00B0M62Q58	0,04		13.10.2021
0,32	iShares Global Clean Energy ETF USD Dist EUR	IE00B1XNHC34	6,87		13.10.2021
0,21	NextEra Energy Inc	US65339F1012		 Versorger	
0,01	iShares MSCI World ETF USD Dist EUR	IE00B0M62Q58	0,27		13.10.2021
0,20	iShares Global Clean Energy ETF USD Dist EUR	IE00B1XNHC34	4,40		13.10.2021
0,18	Xcel Energy Inc	US98389B1008		 Versorger	
0,00	iShares MSCI World ETF USD Dist EUR	IE00B0M62Q58	0,05		13.10.2021
0,18	iShares Global Clean Energy ETF USD Dist EUR	IE00B1XNHC34	3,93		13.10.2021
0,17	Iberdrola SA	ES0144580Y14		 Versorger	
0,00	iShares MSCI World ETF USD Dist EUR	IE00B0M62Q58	0,12		13.10.2021
0,17	iShares Global Clean Energy ETF USD Dist EUR	IE00B1XNHC34	3,60		13.10.2021

Portfolio Positionen

Portfolio Positionen								
Name	Typ	Portfolio Datum	Morningstar Rating	1 Jahr	3 Jahre p.a.	5 Jahre p.a.	Laufende Gewichte	% Kosten
Alphabet Inc Class A	Aktien	14 Okt 2021	-	83,81	30,89	26,46	-	19,61
iShares Healthcare Innov ETF USD Acc EUR	Fonds (ETF)	13 Okt 2021	★★★★	19,05	11,88	14,10	0,40	12,83
Amazon.com Inc	Aktien	14 Okt 2021	-	4,43	17,90	30,65	-	12,24
Tesla Inc	Aktien	14 Okt 2021	-	85,29	144,72	79,64	-	9,51
SPDR® MSCI World Small Cap ETF EUR	Fonds (ETF)	30 Sep 2021	★★★	41,24	10,76	11,48	0,45	8,57
Skyworks Solutions Inc	Aktien	14 Okt 2021	-	18,44	25,59	18,29	-	5,81
Xtrackers MSCI World Swap ETF 1C EUR	Fonds (ETF)	30 Sep 2021	★★★★	30,64	13,51	13,25	0,45	5,41
JD.com Inc ADR	Aktien	14 Okt 2021	-	-5,26	41,38	22,34	-	4,87
iShares Global Clean Energy ETF USD Dist EUR	Fonds (ETF)	13 Okt 2021	★★★	18,45	37,47	20,08	0,65	4,63
iShares MSCI World ETF USD Dist EUR	Fonds (ETF)	13 Okt 2021	★★★★	30,58	13,19	12,93	0,50	2,93
Baidu Inc ADR	Aktien	14 Okt 2021	-	21,61	-12,40	-3,99	-	2,89
Keysight Technologies Inc	Aktien	14 Okt 2021	-	72,07	36,86	39,37	-	2,34
Alibaba Group Holding Ltd ADR	Aktien	14 Okt 2021	-	-48,59	-3,42	6,14	-	2,08
SFC Energy AG	Aktien	14 Okt 2021	-	93,49	55,93	67,05	-	1,94
Tencent Holdings Ltd	Aktien	14 Okt 2021	-	-11,05	13,79	15,78	-	1,89
Xtrackers MSCI Europe Small Cap ETF 1C EUR	Fonds (ETF)	13 Okt 2021	★★★	38,39	10,66	11,02	0,30	1,32
Apple Inc	Aktien	14 Okt 2021	-	24,19	37,89	39,10	-	1,14
Wirecard AG	Aktien	14 Okt 2021	-	-70,54	-89,28	-65,43	-	0,00

Offenlegung

Die in der Vergangenheit erzielten Erfolge sind keine Garantie für die zukünftige Entwicklung.

Die Erträge der Fonds reflektieren kein aktiven Handel und zeigen somit nicht notwendigerweise die Resultate die mit aktivem Management des Depots hätten erzielt werden können. Die erreichte Wertentwicklung anderer Kunden des Beraters kann grundlegend anders sein als die der hier gezeigten Investments.

Vermögensaufteilung

Das Kuchendiagramm und die Tabelle zeigen die Aufteilung des Portfolios nach folgenden Klassen: Aktien, Anleihen, Cash und Sonstige. Die Kategorie "Sonstige" repräsentiert eine Assetklasse die Morningstar zwar bekannt ist, jedoch in keine der voran genannten Kategorien passt. So sind beispielsweise Immobilien typischerweise der Kategorie "Sonstige" zugeordnet. "Nicht klassifiziert" wird den Titeln zugeordnet, die Morningstar nicht erkennt oder verfolgt. Die Tabelle neben dem Kuchendiagramm zeigt die prozentuale Netto-Vermögensaufteilung des Portfolios, ebenso wie die Long-Positionen (Vermögen) und Short-Positionen (Verbindlichkeiten) des Portfolios.

Weltregionen

Dieser Datensatz verdeutlicht die grobe geografische Aufteilung des Portfolios nach Region und Laufzeiten. Die Berechnung erfolgt auf dem Aktienanteil des Portfolios, Liquidität wird nicht berücksichtigt. "Nicht klassifiziert" wird dem Aktienanteil des Portfolios zugewiesen, bei dem Morningstar die Herkunft oder Region nicht bestimmen kann.

Branchensektoren

Diese Tabelle zeigt den Prozentsatz des Portfolio-Aktienanteils, welcher jedem der drei Supersektoren (Information, Service und Produktion) und den 12 wichtigsten Industriesubsektoren zugeordnet ist. "Nicht klassifiziert" bezieht sich auf die Titel, die Morningstar nicht kennt oder verfolgt.

Top 10 Positionen

Diese Aufzählung zeigt bis zu 10 der am höchsten gewichteten dem Portfolio zugrunde liegende Positionen. Dargestellt werden der prozentuale Anteil im Portfolio, der Wertpapiertyp, die Sektorklassifizierung und das Ursprungsland.

Wertentwicklung

Die Wertentwicklung wird ohne Ausgabeaufschläge oder steuerliche Faktoren berechnet. Jedoch sind alle laufenden Kosten des Fonds berücksichtigt, Ausschüttungen werden als wieder angelegt angenommen. Ausgabeaufschläge oder Kaufgebühren würden die ausgewiesene Wertentwicklung reduzieren.

Die Wertentwicklungen der Portfolios werden wie folgt berechnet: die monatlichen Wertentwicklungen der zugrunde liegenden Titel werden gemäß der Vermögensaufteilung gewichtet und zeigen so den (Vorsteuer)Ertrag den ein Investor bei monatlicher Neugewichtung seines Portfolios erzielt hätte. Die selben Werte werden zur Berechnung der statistischen Kennziffern verwandt. Die Erträge einzelner Titel sind prozentuale Wertentwicklungen.

Risiko-Ertragsprofil

Das Sharpe-Ratio ist eine risikoadjustierte Kennzahl, berechnet mittels Standardabweichung und Mehrertrag, die den Ertrag pro Risikoeinheit darstellt. Je höher das Sharpe-Ratio, desto besser ist die historische risikoadjustierte Wertentwicklung. Das Sharpe-Ratio wird über die letzten 36 Monatperioden berechnet. Hierbei wird der Mehrertrag durch die Standardabweichung des Mehrertrages des Fonds dividiert. Da diese Kennzahl die Standardabweichung als Risikodeterminante heranzieht, wird die höchste Aussagekraft erzielt wenn ein Fonds analysiert wird, der die einzige Position eines Investors darstellt. Das Sharpe-Ratio kann benutzt werden um zwei Fonds direkt miteinander zu vergleichen um herauszufinden, wieviel Risiko ein Fonds aufnehmen muss um einen Mehrertrag gegenüber einer risikolosen Anlage zu erreichen.

Die Standardabweichung verdeutlicht, wie weit die Werte einer Wertewolke sich über- und unterhalb des Durchschnittes befinden. Ist die Standardabweichung eine hohe positive oder negative Zahl, dann hat sich der Fonds entsprechend weit über oder dem Durchschnitt entwickelt. Ist die Standardabweichung gering, dann hat der Fonds sich näher am Durchschnitt entwickelt.

Der Mittelwert ist die annualisierte Wertentwicklung eines Fonds über drei Jahre.

Chart

Die Wertentwicklungen werden ohne Ausgabeaufschläge oder steuerliche Faktoren berechnet. Jedoch sind alle laufenden Kosten des Fonds berücksichtigt, Ausschüttungen werden als wieder angelegt angenommen. Ausgabeaufschläge oder Kaufgebühren würden die ausgewiesene Wertentwicklung reduzieren.

Risiko-Ertrag Punktediagramm

Das Risiko-Ertrags Diagramm basiert auf dem Risiko- und Ertragsprofil jeder zugrunde liegenden Position über die letzte 3-Jahresperiode. Das Risiko wird als 3-Jahres Standardabweichung des Ertrages gemessen. Der Ertrag wird als 3-Jahres Durchschnittsertrag gemessen. Das Risiko-Ertrags Diagramm zeigt weiterhin das Risiko und den Ertrag des Portfolios.

Korrelationsmatrix

Diese Matrix zeigt die Korrelation der Performance zwischen den unterschiedlichen Positionen. Eine Korrelation von 1 besagt dass zwei Positionen sich in die selbe Richtung bewegen, eine Korrelation von -1 besagt dass zwei Positionen in gegensätzliche Richtungen bewegen und eine Korrelation von 0 bedeutet, dass keine Korrelation besteht. Eine Korrelation von -1 bietet eine maximale Diversifikation.