

Simulation Anlageansatz Swiss Performance Reputation Selection

Der Anlageansatz «Swiss Performance Reputation Selection» hat zum Ziel, aus rund 100 an der Schweizer Börse kotierten Unternehmen wöchentlich die 20 best-reputierten Unternehmen herauszufiltern und reputationsgewichtet abzubilden. Gewichtungskriterium bildet die sedimentierte Reputation (SRI®) der einzelnen Unternehmen.

Gewichtungsstrategie: Balanced-weighted (moderate Übergewichtung der Reputationseffekte)

Details Anlageansatz	
Basis	Reputationsdaten commsLAB/fög-UZH Kursinformationen SIX Financial Information
Reputationsdaten	Corporate Reputation (Gewichtung im Scoring: 100%)
Ausschüttungen	Keine. Netto-Dividenden (65%) werden reinvestiert
Aktienauswahl	Ausreichend Präsenz des Unternehmens in öffent- lich zugänglichen Quel- len, Börsenkapitalisierung von mind. CHF 200 Mio., täglich durchschnittlicher Handelsumsatz von mind. CHF 2 Mio. Es werden zu jedem Zeitpunkt 20 Unterneh- men im Portfolio abgebildet (Stock-Picking)
Auswahlkriterium	Sedimentierte Resonanz und an der Schweizer Börse gelistet
Periodizität	Wöchentliche Anpassung der Gewichtungen (jeweils Freitag zu Schlusskursen)
Gewichtung	Balanced-weighted: Fixe Portfoliogewichte, wobei eine positive Reputation übergewichtet wird <i>Effektive Gewichte siehe 'Aktuelle Positionen'</i>

Rendite pro Jahr / Total (Simulation)

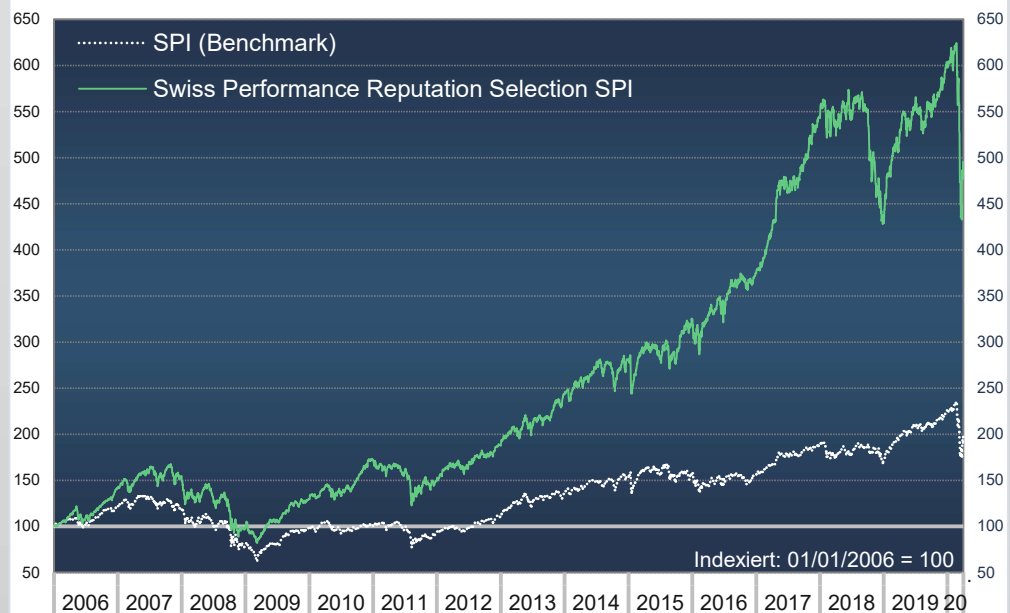
Jahr	SPI	Portfolio	Delta
2006	20.67%	41.13%	20.46%
2007	-0.05%	9.36%	9.42%
2008	-34.05%	-35.74%	-1.69%
2009	23.18%	30.63%	7.45%
2010	2.92%	32.23%	29.31%
2011	-7.72%	-12.64%	-4.92%
2012	17.72%	25.26%	7.54%
2013	24.60%	29.84%	5.24%
2014	13.00%	15.18%	2.18%
2015	2.68%	15.59%	12.92%
2016	-1.41%	15.45%	16.86%
2017	19.92%	45.05%	25.13%
2018	-8.57%	-19.33%	-10.76%
2019	30.59%	36.45%	5.85%
2020/03	-11.82%	-17.05%	-5.23%
TOTAL	97.12%	395.52%	298.40%

Anlageansatz Swiss Performance Reputation Selection SPI

Performance 2006 - 31/03/2020 (Benchmark: SPI)

Balanced-weighted

© commsLAB AG /
fög - Universität
Zürich



Aktuelle Positionen per 31/03/2020 (Simulation Anlageansatz)

Peer	In %	Peer	In %	Peer	In %	Peer	In %
ALLN.S	9.52%	VIFN.S	7.14%	PGHN.S	4.76%	BCVN.S	2.38%
GALE.S	9.05%	LOGN.S	6.67%	BUCN.S	4.29%	BALN.S	1.90%
PSPN.S	8.57%	EMSN.S	6.19%	BARN.S	3.81%	LISP.S	1.43%
SIKA.S	8.10%	SPSN.S	5.71%	STMN.S	3.33%	IDIA.S	0.95%
VACN.S	7.62%	HELN.S	5.24%	ZURN.S	2.86%	GIVN.S	0.48%

Facts per 31/03/2020 (Simulation Anlageansatz)

Kennzahlen vor Abzug von Gebühren (annualisiert)	Swiss Performance Reputation Selection (Simulation Portfolio)				SPI (Benchmark)			
	1 Year	3 Year	5 Year	Total	1 Year	3 Year	5 Year	Total
Risikoloser Zinssatz: 0.0%								
Log Return in %	-3.94	5.42	10.52	11.19	0.69	5.30	4.11	4.75
Volatility in %	21.16	17.22	16.36	17.33	20.33	15.16	15.34	17.20
Sharp Ratio	-0.19	0.31	0.64	0.65	0.03	0.35	0.27	0.28
Correlation	0.90	0.86	0.87	0.87	1	1	1	1
Beta	0.94	0.97	0.92	0.87	1	1	1	1
Jensen's Alpha in %	-4.60	0.27	6.73	7.05				
Information Ratio	-0.50	0.01	0.77	0.72				
Tracking Error in %	9.19	8.90	8.29	8.92				
Performance in %	-3.87	17.70	70.92	395.52	0.00	17.45	23.88	97.12
Max. Drawdown in %	-30.64	-30.64	-30.64	-51.20	-26.33	-26.33	-26.33	-53.25