



Bayerische Vermögen

Fondskongress 2017

Stefan Mayerhofer
Bayerische Vermögen AG

www.bv-vermoegen.de

Stand 01/2017

STOXX 600 EUROPE

18 Länder

19 Sektoren

600 Aktienwerte

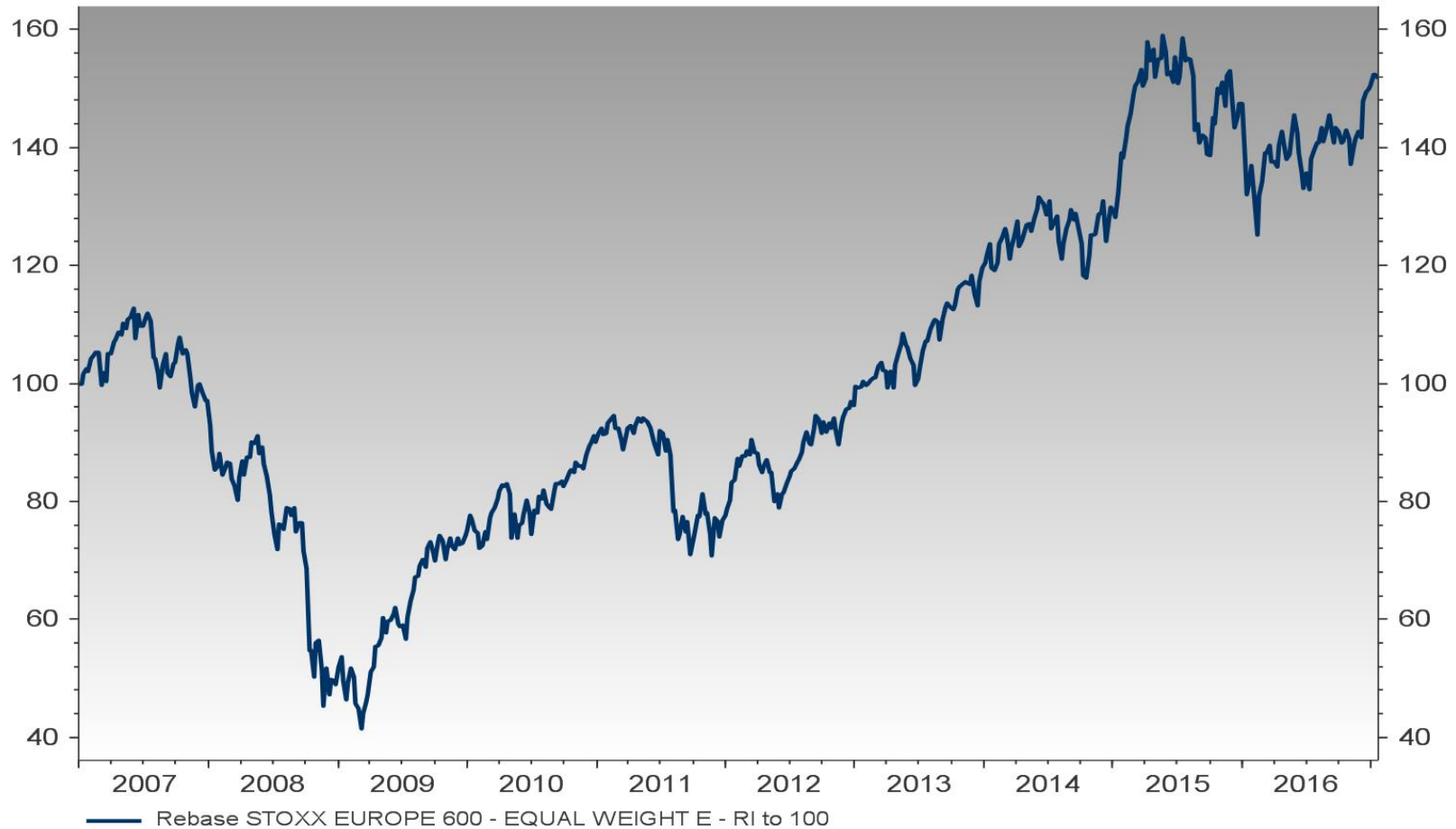
Marktkapitalisierung:

222,2 Mrd. EUR Größter Wert

0,8 Mrd. EUR Kleinster Wert



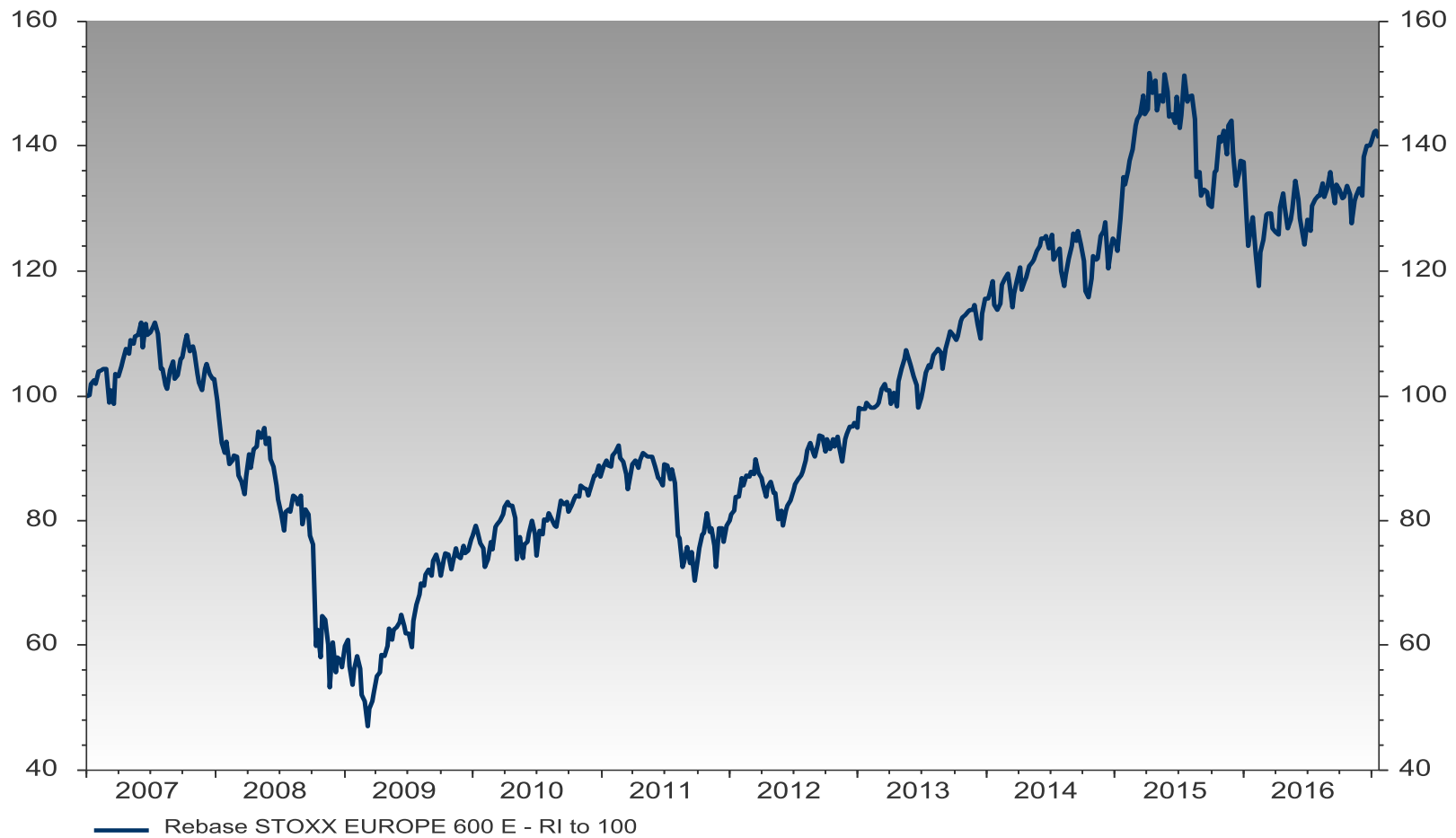
STOXX 600 equal weight



Quelle: Thomson Reuters Datastream

- Liquidität
- Rechtssicherheit
- Transparenz

STOXX 600

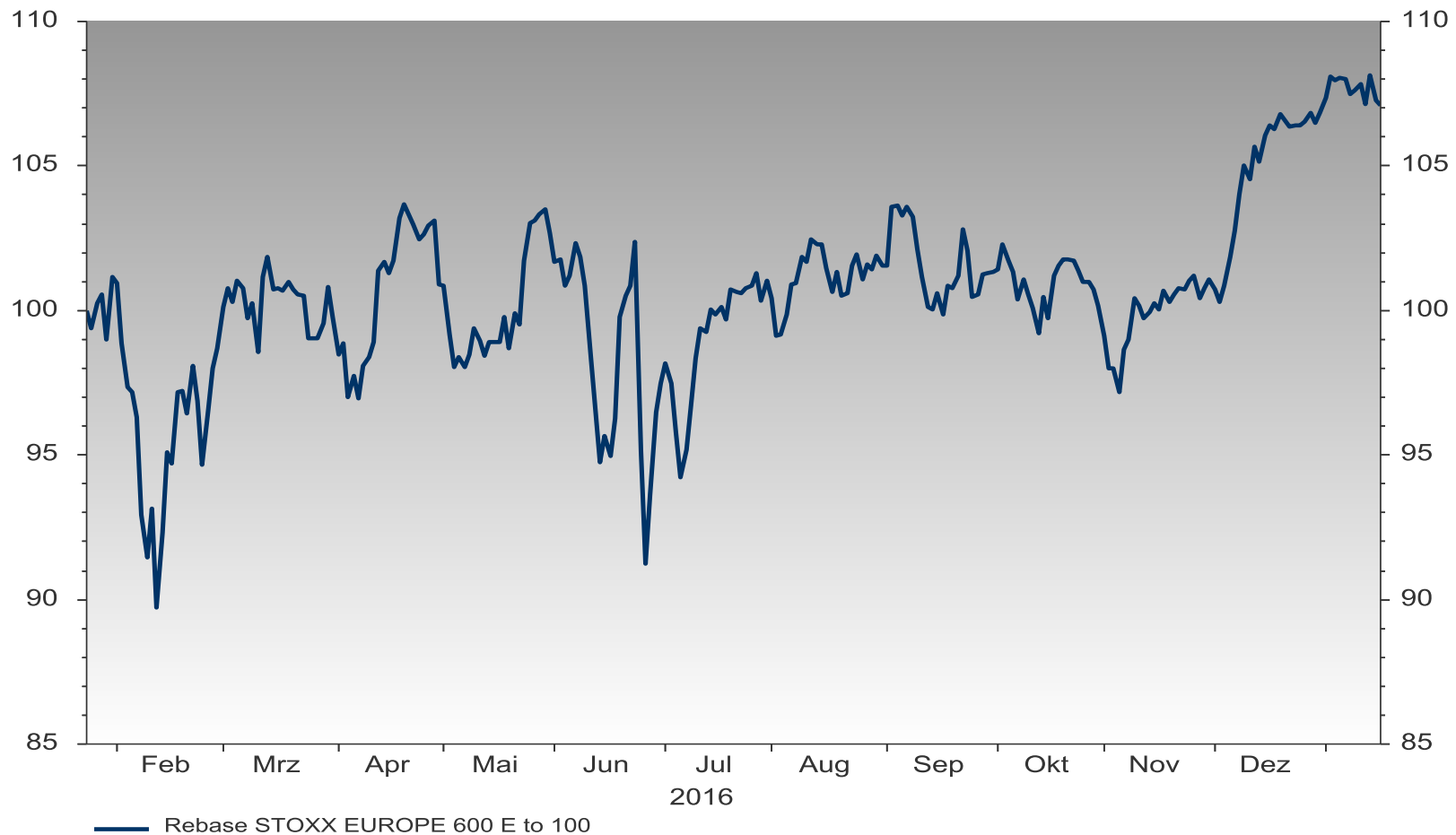


Quelle: Thomson Reuters Datastream

19 Supersektoren

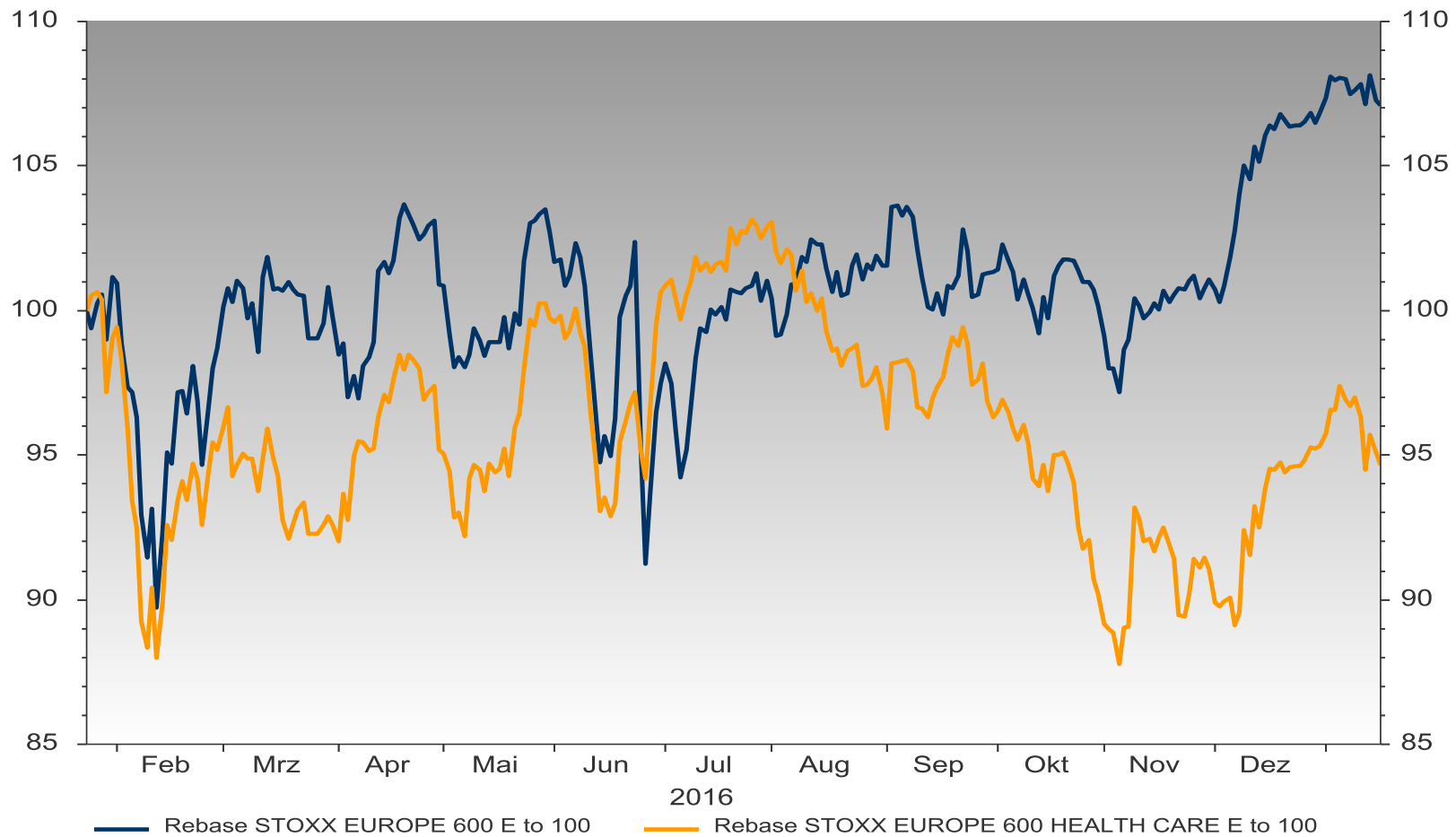
Name	Perf. 1M	Perf. 3M	Perf. 6M	Perf. 1J	Perf. 5J	Perf. 10J
STXE 600 BASIC RESOURCES	11,6	25,8	39,3	107,7	-15,7	-20,9
STXE 600 OIL & GAS	-1,4	7,0	11,3	35,1	11,7	14,3
STXE 600 INDUSTRIAL G&S	1,3	6,2	10,6	18,3	55,4	46,9
STXE 600 CONSTR. & MATERIALS	1,3	3,9	11,9	16,5	72,6	4,2
STXE 600 CHEMICALS	1,2	6,6	12,0	15,0	56,8	104,0
STXE 600 AUTOMOBILES & PARTS	1,2	12,4	19,2	14,2	78,2	83,1
STXE 600 PERS. & HOUSEH.GOODS	2,7	3,9	2,6	11,6	104,0	153,6
STXE 600	0,3	5,2	6,9	9,9	62,1	29,9
STXE 600 BANKS	0,3	14,5	28,7	8,7	15,3	-67,3
STXE 600 TECHNOLOGY	0,2	3,5	4,0	8,7	95,2	41,6
STXE 600 FINANCIAL SERVICES	1,9	6,1	9,0	7,2	87,6	-13,4
STXE 600 INSURANCE	-2,5	9,4	19,2	6,5	110,5	28,5
STXE 600 MEDIA	-1,4	4,0	0,6	-1,1	91,7	50,1
STXE 600 TRAVEL & LEISURE	-0,6	7,1	4,9	-1,7	119,1	39,8
STXE 600 FOOD & BEVERAGE	0,5	-3,7	-6,6	-2,1	59,7	103,1
STXE 600 RETAIL	-1,4	-0,7	2,9	-2,2	42,4	19,8
STXE 600 UTILITIES	-0,9	-3,3	-8,7	-2,6	35,1	-8,6
STXE600 REAL ESTATE	-2,6	-2,8	-7,6	-3,0	73,2	-14,7
STXE 600 HEALTH CARE	-1,9	-2,1	-9,7	-7,2	60,1	50,4
STXE 600 TELECOMMUNICATIONS	1,2	2,6	-1,4	-8,3	46,1	39,8

Im Vergleich STOXX 600 mit health care und food+beverage



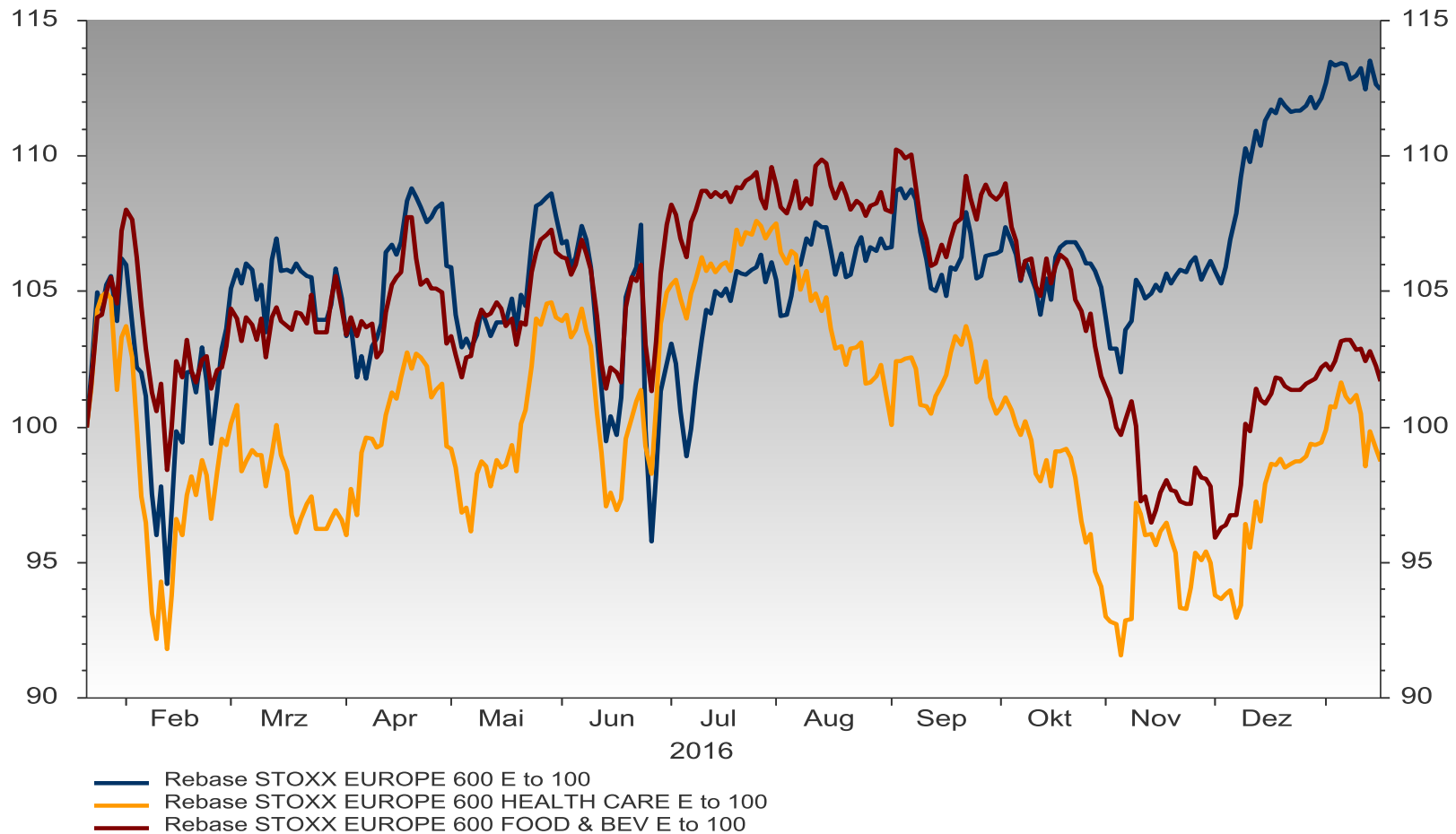
Quelle: Thomson Reuters Datastream

Im Vergleich STOXX 600 mit health care und food+beverage



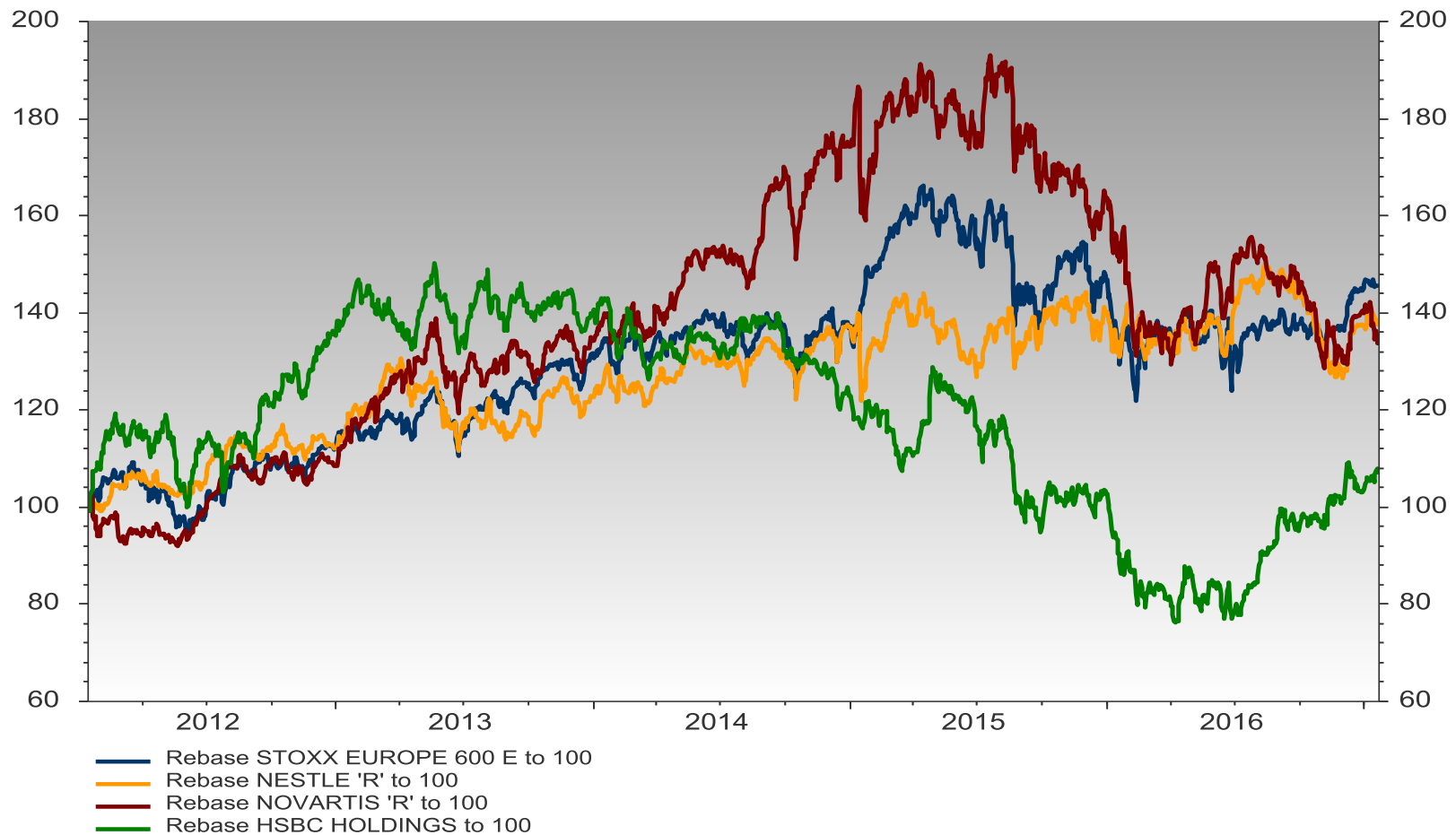
Quelle: Thomson Reuters Datastream

Im Vergleich STOXX 600 mit health care und food+beverage



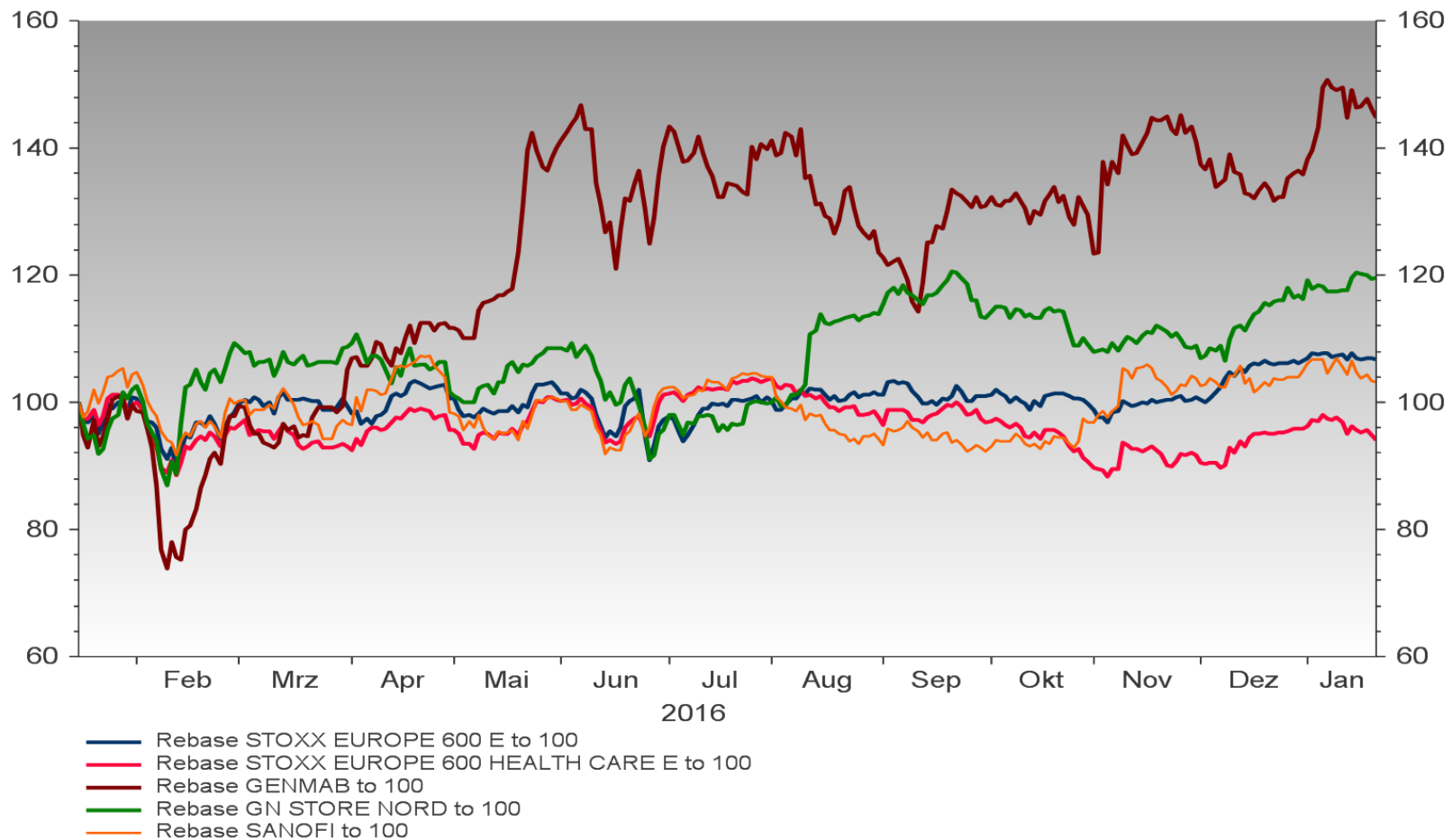
Quelle: Thomson Reuters Datastream

STOXX 600 im Vergleich



Quelle: Thomson Reuters Datastream

STOXX 600 im Vergleich



Quelle: Thomson Reuters Datastream

Monatsbericht

STOXX 600 Aktiv / Kennzahlen (31.12.2011 – 31.12.2016)

	Aktien 100%	Aktien mit Quotensteuerung	STOXX 600
Performance p.a.	11,93%	8,55%	8,13%
Vola	14,62%	7,84%	15,00%
Sharpe Ratio	0,82	1,09	0,54
Max DD	20,11%	9,48%	24,34%

Quelle: Bayerische Vermögen Asset Management

Aktien 100%: Indexierte Entwicklung des Aktienportfolios des Mayerhofer Strategie AMI Fonds ohne Cash/Renten/Derivate/etc.

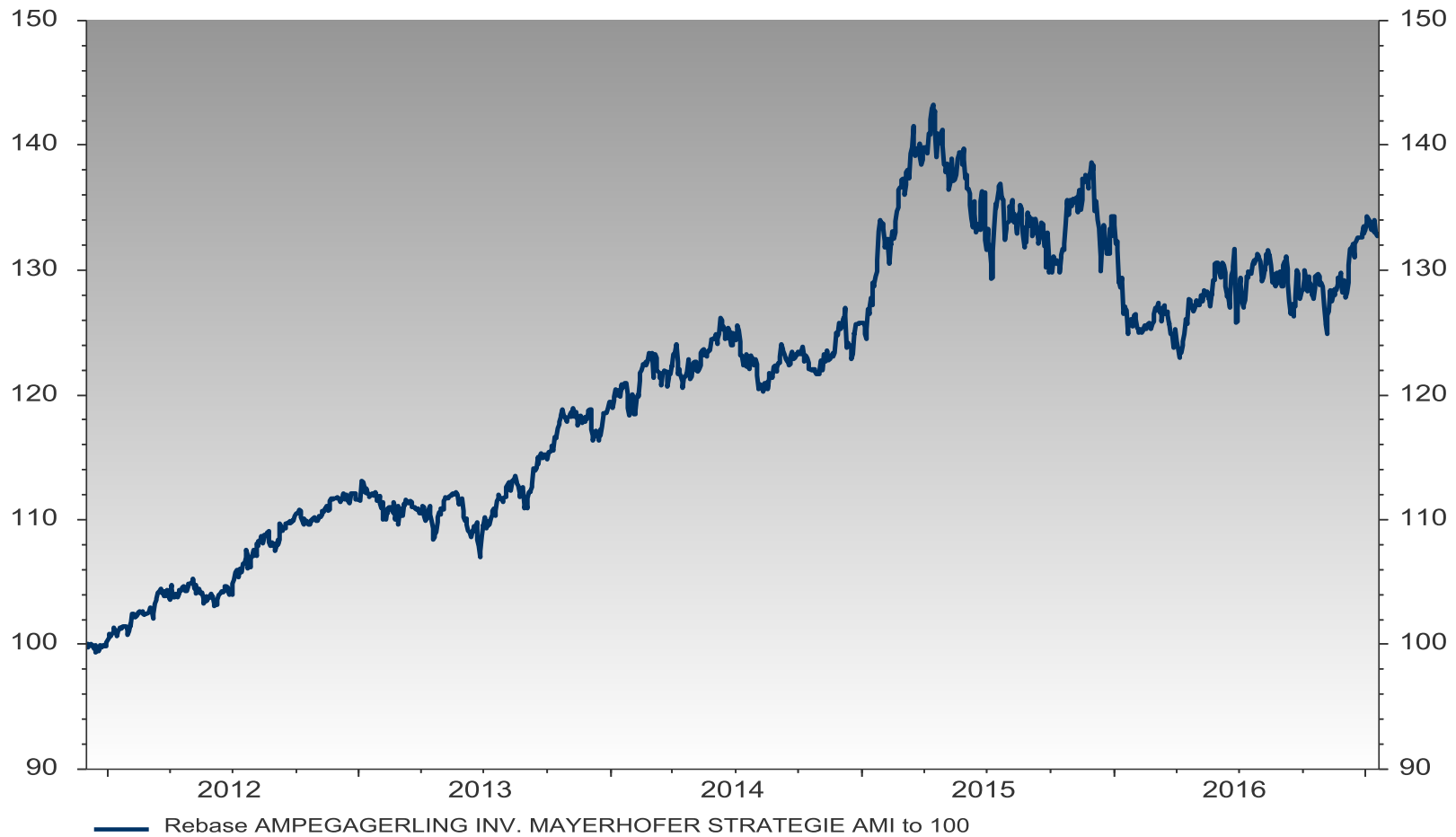
Aktien mit Quotensteuerung: Die Basis ist das Portfolio Aktien 100% inkl. der Berücksichtigung einer aktiven Aktienquotensteuerung sowohl über physische Käufe/Verkäufe sowie mittels derivativer Elemente. Beide Portfolios beinhalten einige Annahmen und stellen keine exakten Berechnungen dar. Die Transaktionskosten sind nicht berücksichtigt worden.

A man with short, light-colored hair, wearing a dark pinstriped suit, a white shirt, and a red patterned tie, stands with his hands clasped in front of him. He is leaning against a large, light-colored concrete pillar. The background is a blurred indoor setting with some blue light visible.

Mayerhofer Strategie Fonds AMI

Track Record & Kennzahlen

Mayerhofer Strategie Fonds AMI



Quelle: Thomson Reuters Datastream

Wertentwicklung 2012-2016

Mayerhofer Strategie Fonds AMI

Datum	Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	Jahresperf.
2011												0,18%	0,18%
2012	0,54%	1,87%	0,96%	1,25%	-1,04%	0,16%	3,52%	-0,11%	2,64%	-0,38%	1,79%	-0,19%	11,49%
2013	-0,29%	-0,66%	-0,07%	0,35%	-0,16%	-0,99%	2,02%	-0,37%	3,38%	2,70%	0,82%	0,63%	7,51%
2014	0,48%	2,36%	-0,40%	0,16%	1,64%	0,21%	-1,95%	-0,47%	1,35%	-1,31%	3,40%	-0,01%	5,47%
2015	6,26%	2,65%	1,91%	-1,00%	0,32%	-4,66%	1,04%	0,43%	-3,37%	4,58%	1,66%	-2,37%	7,13%
2016	-6,60%	0,32%	-0,51%	1,88%	2,35%	-2,75%	3,21%	-0,92%	-1,16%	0,59%	0,16%	3,62%	-0,59%

Auflage-Datum:	01.12.2011
Performance seit Auflage	34,87%
Performance p.a. seit Auflage	5,49%
Max DD.	13,91%
Volatilität (annualisiert seit Auflage)	8,53%
Value at Risk (99%/10 Tage)	7,70%
Sharpe Ratio (Zins = 0%), seit Auflage	0,64

Vielen Dank für Ihre Aufmerksamkeit!



Bayerische Vermögen