

Daten und Fakten

Risikoklasse



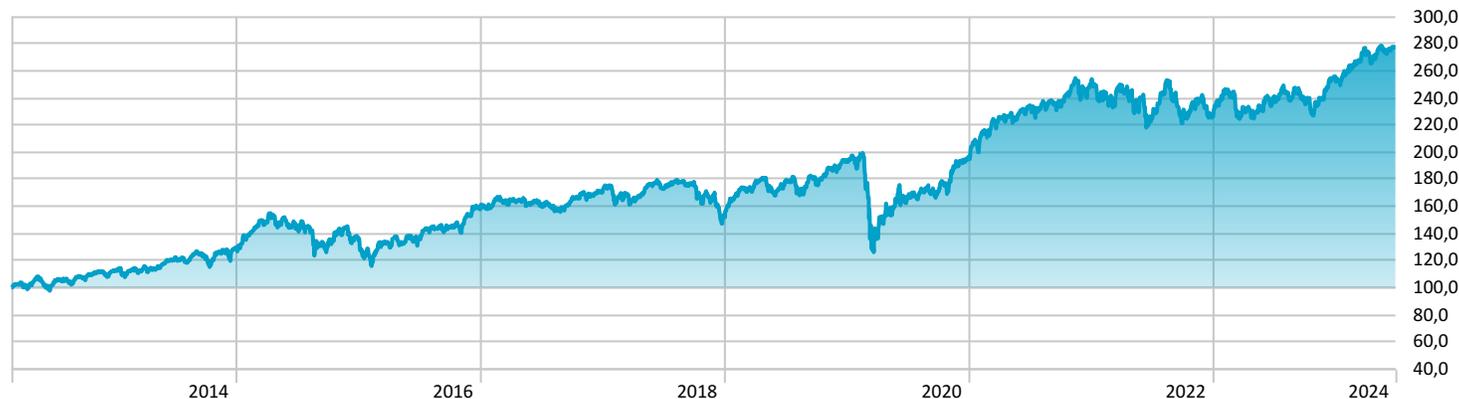
- 1
Sicherheits-orientiert
- 2
Ertrags-orientiert
- 3
Wachstums-orientiert
- 4
Chancen-orientiert
- 5
Spekulativ

Anlageziel und Strategie

Die BAYONAIINVEST Strategie 100 investiert in Aktien von Unternehmen, die an Hauptbörsen in entwickelten Ländern notiert sind und in Aktien von kleineren und Value Unternehmen, sowie in Aktien aus Schwellenländern. Sie bietet ein breitdiversifiziertes Engagement am globalen Aktienmarkt mit einer leichten Übergewichtung in Value- und Smallcaps. Anlageziel ist die langfristige Wertsteigerung und Ertragserzielung unter Inkaufnahme von Kapitalmarktrisiken.

Wertentwicklung - grafisch -

Zeitraum: 02.03.2013 bis 30.06.2024



Bayonainvest Strategie 100

Wertentwicklung

	1 M	6 M	YTD	1 Jahr	2 Jahre	Seit Auflage
Bayonainvest Strategie 100	0,80%	8,80%	8,80%	15,57%	24,67%	146,53%

Strategiebeschreibung

Die BAYONAIINVEST nutzt zur Entwicklung ihrer Strategien konsequent und diszipliniert die Ergebnisse der modernen weltweiten Kapitalmarktforschung: Harry Markowitz, Merton H. Miller, Kenneth French, Eugene Fama, John Bogle, Gerd Kommer.

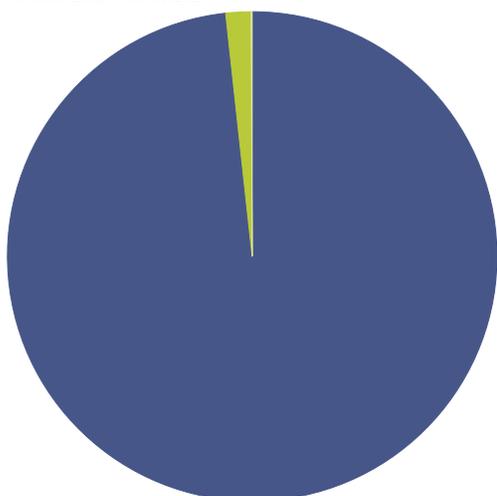
In der Umsetzung bedient sie sich kosteneffizienter und breit diversifizierter passiver Instrumente (ETFs & Assetklassenfonds) wie z.Bsp. von Dimensional und Vanguard. Das turnusmäßige und regelbasierte Rebalancing der Portfolien erfüllt die Aufgabe des Risikomanagement.

Aktuelle Allokation

	ISIN	Anteil
Dimensional Global Core Equity EUR Dist	IE00B3M0BZ05	46,59%
Dimensional Global Trgt'd Value EUR Dist	IE00B6897102	21,33%
Dimensional Global Small Coms EUR Dist	IE00B3XNN521	19,00%
iShares MSCI EM ETF USD Dist	IE00B0M63177	11,75%

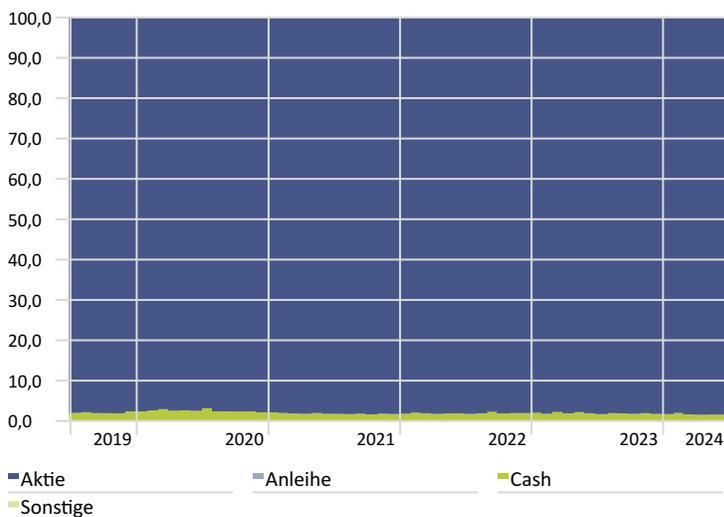
Gewichtung Anlageklassen

Portfolio-Datum: 30.06.2024



Anlageklasse	Anteil (%)
Aktie	98,3
Anleihe	0,0
Cash	1,7
Sonstige	0,1

Verlauf der Anlageklassengewichtungen

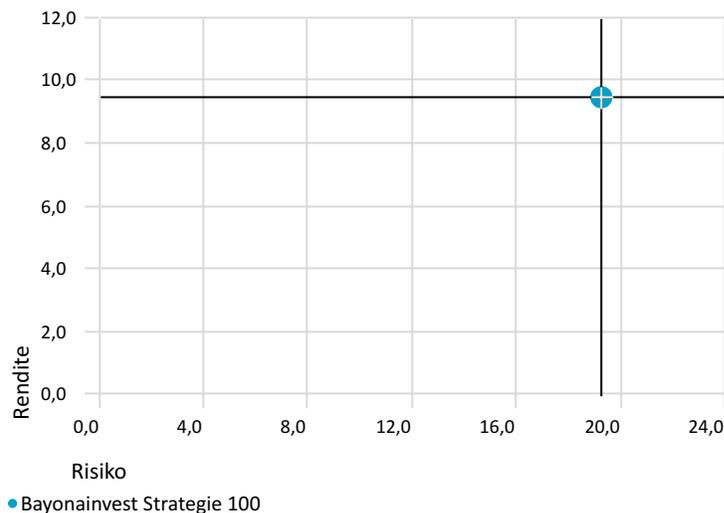


Statistische Daten

Zeitraum: 02.03.2013 bis 30.06.2024

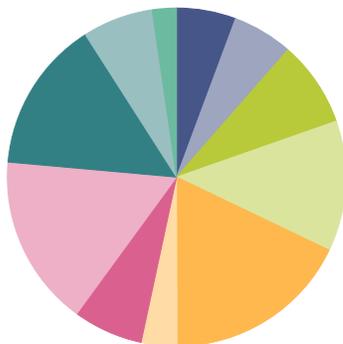
Rendite p.a.	9,43%
Standardabweichung	19,22%
Max. Verlust	-36,72%
Korrelation	—
Sharpe Ratio	0,51

Rendite-Risiko Diagramm



Aktien - Branchenverteilung

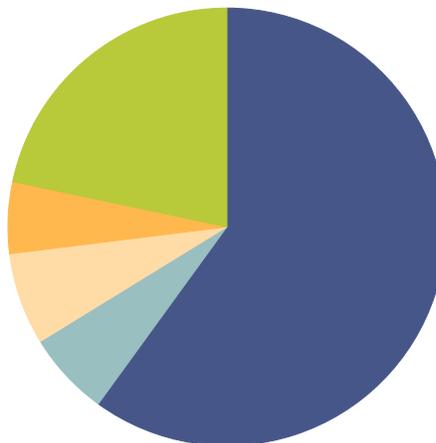
Portfolio-Datum: 30.06.2024



Branchenverteilung	Anteil (%)
Kommunikation	5,7
Konsumgüter, nicht zyklisch	5,8
Gesundheitswesen	8,2
Konsumgüter, zyklisch	12,5
Finanzdienstleistungen	17,8
Immobilien	3,4
Energie	6,7
Technologie	16,4
Industrie	14,5
Rohstoffe	6,8
Versorger	2,3

Aktien - Verteilung nach Regionen

Portfolio-Datum: 30.06.2024



Region	Anteil (%)
USA	60,0
Japan	6,2
Grossbritannien	3,8
Kanada	3,0
China	3,0
Indien	2,3
Sonstige	21,7
Gesamt	100,0