

Daten und Fakten

Risikoklasse

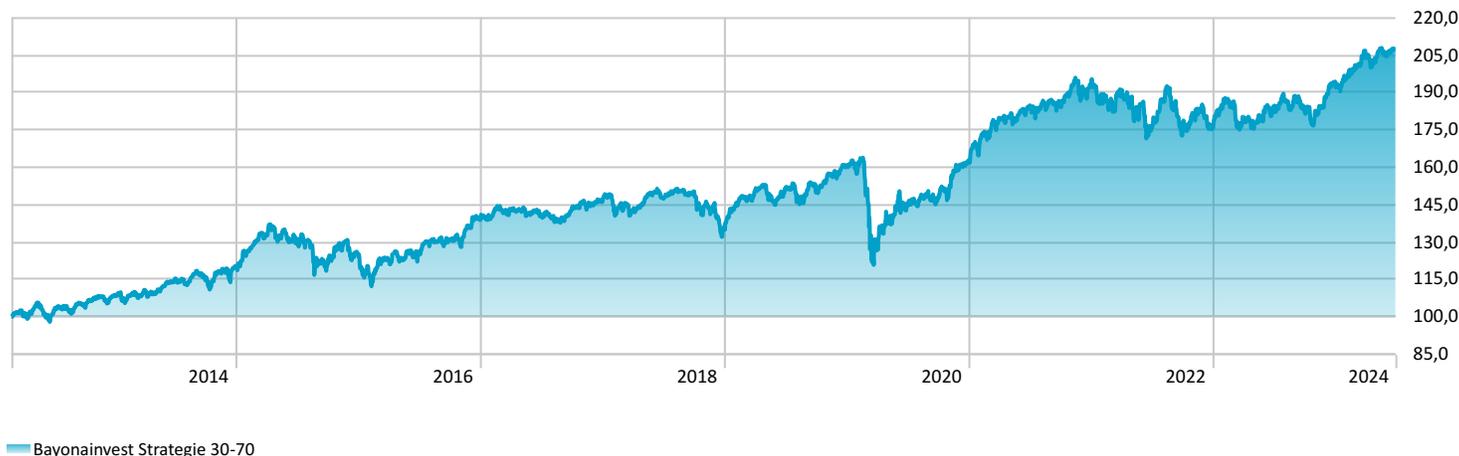


Anlageziel und Strategie

Die BAYONAINVEST Strategie 30/70 investiert 70% 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 breit diversifiziertes Engagement am globalen Aktienmarkt mit einer leichten Übergewichtung in Value und Smallcaps. Die Beimischung von 30% Anleihen ETFs und Assetklassenfonds mit bester bis guter Bonität und kurzen Laufzeiten verringert das erwartete Risiko, bzw. die Volatilität der Portfolien. Anlageziel ist die langfristige Wertsteigerung und Ertragserzielung unter Inkaufnahme von Kapitalmarktrisiken.

Wertentwicklung - grafisch -

Zeitraum: 02.03.2013 bis 30.06.2024



Wertentwicklung

	1 M	6 M	YTD	1 Jahr	2 Jahre	Seit Auflage
Bayonainvest Strategie 30-70	0,71%	7,00%	7,00%	12,71%	18,87%	91,11%

Strategiebeschreibung

Die BAYONAINVEST 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.

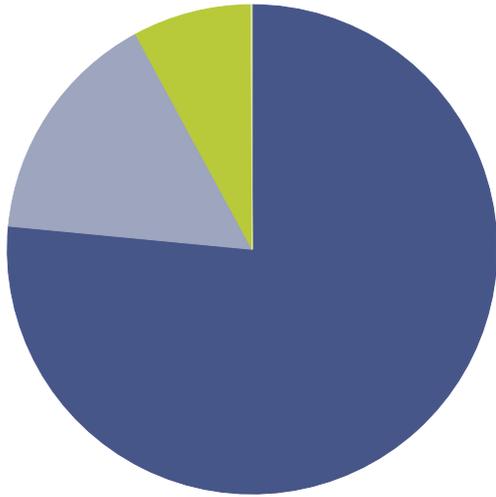
In der Umsetzung bedient sie sich kosteneffizienter und breit diversifizierter passiver Instrumente (ETFs & Assetklassenfonds) wie z.Bsp. von Dimensional und Vanguard. Das turnusmäßige und regelbasierte Rebalancing der Portfolien erfüllt die Aufgabe des Risikomanagement.

Aktuelle Allokation

	ISIN	Anteil
Dimensional Global Core Equity EUR Dist	IE00B3M0BZ05	36,01%
Dimensional Global Trgt'd Value EUR Dist	IE00B6897102	16,82%
Dimensional Global Small Coms EUR Dist	IE00B3XNN521	14,98%
Vanguard Glbl Sh-Tm Bd Idx Inv EURH Acc	IE00BH65QK91	10,85%
Dimensional Global Sht Fxd Inc EUR Dist	IE00B3QL0Y14	10,57%
iShares MSCI EM ETF USD Dist	IE00B0M63177	9,27%

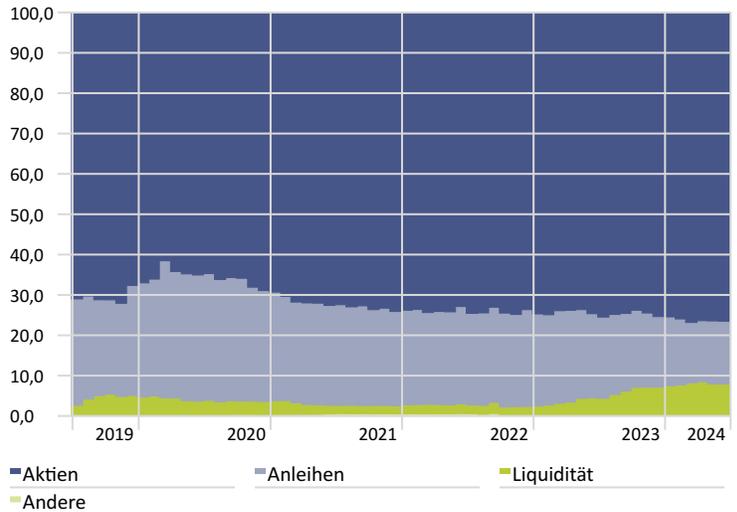
Gewichtung Anlageklassen

Portfolio-Datum: 30.06.2024



Anlageklasse	Anteil (%)
Aktien	76,5
Anleihen	15,6
Liquidität	7,8
Andere	0,1

Verlauf der Anlageklassengewichtungen

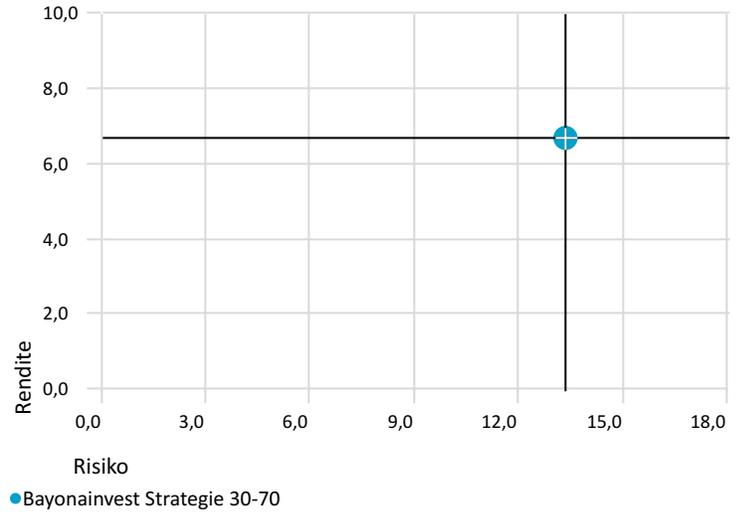


Statistische Daten

Zeitraum: 02.03.2013 bis 30.06.2024

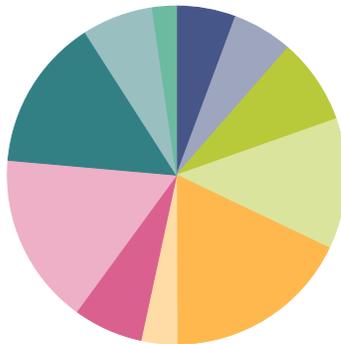
Rendite p.a.	6,65%
Standardabweichung	13,33%
Max. Verlust	-26,28%
Korrelation	—
Sharpe Ratio	0,36

Rendite-Risiko Diagramm



Aktien - Branchenverteilung

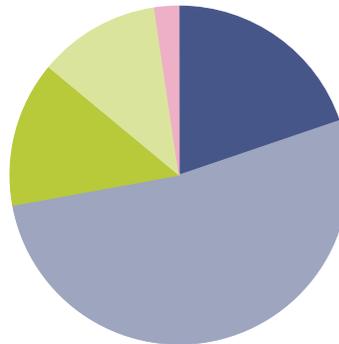
Portfolio-Datum: 30.06.2024



Branche	Anteil (%)
Kommunikation	5,7
Konsumgüter, nicht zyklisch	5,8
Gesundheitswesen	8,2
Konsumgüter, zyklisch	12,5
Finanzdienstleistungen	17,9
Immobilien	3,4
Energie	6,7
Technologie	16,4
Industrie	14,5
Rohstoffe	6,8
Versorger	2,3

Renten - Ratingverteilung

Portfolio-Datum: 30.06.2024



Rating	Anteil (%)
AAA	19,8
AA	52,3
A	13,9
BBB	11,6
Not Rated	2,3
Sonstige	0,0