

## Daten und Fakten

### Risikoklasse

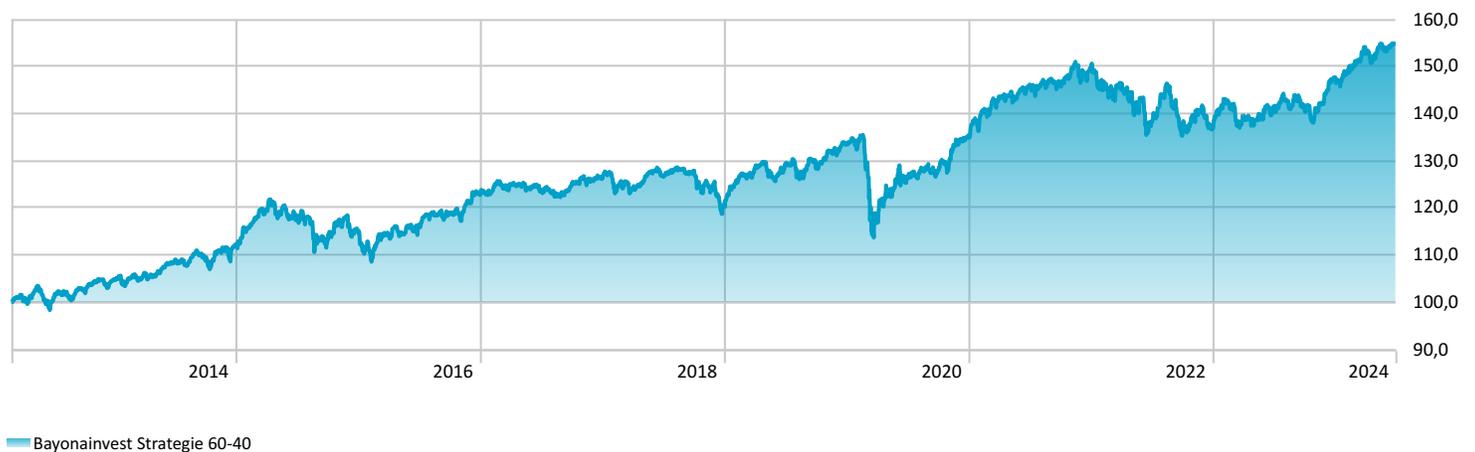


### Anlageziel und Strategie

Die BAYONAIiNVEST Strategie 60/40 investiert 40% 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 60% 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 60-40	0,63%	5,01%	5,01%	9,57%	12,79%	47,82%

### 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.

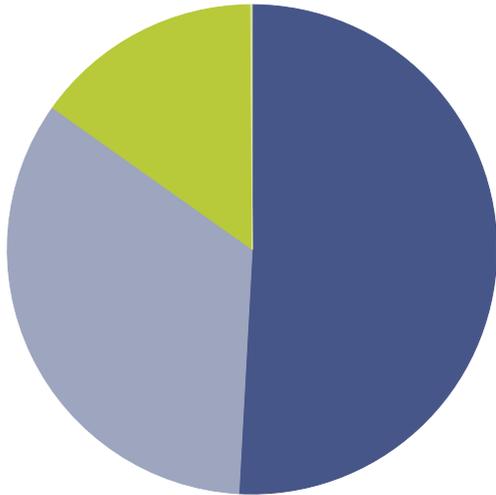
In der Umsetzung bedient sie sich kosteneffizienter und breit diversifizierter passiver Instrumente (ETFs & Assetklassenfonds) wie z.Bsp. von Dimensional und Vanguard. Das turnusmäßige und regelbasierte Rebalancing der Portfolien erfüllt die Aufgabe des Risikomanagement.

### Aktuelle Allokation

	ISIN	Anteil
Dimensional Global Core Equity EUR Dist	IE00B3M0BZ05	24,87%
Vanguard Gbl Sh-Tm Bd Idx Inv EURH Acc	IE00BH65QK91	23,74%
Dimensional Global Sht Fxd Inc EUR Dist	IE00B3QL0Y14	23,12%
Dimensional Global Trgtd Value EUR Dist	IE00B6897102	10,88%
Dimensional Global Small Coms EUR Dist	IE00B3XNN521	9,69%
iShares MSCI EM ETF USD Dist	IE00B0M63177	5,99%

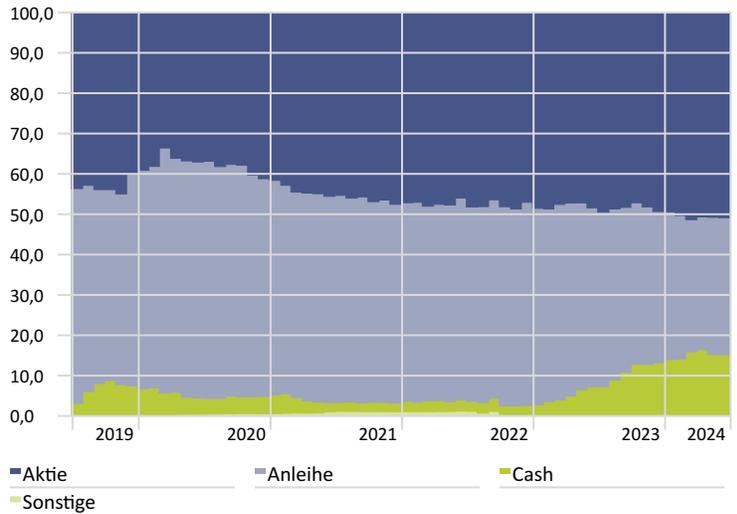
### Gewichtung Anlageklassen

Portfolio-Datum: 30.06.2024



Anlageklasse	Anteil (%)
Aktien	50,9
Anleihen	34,0
Liquidität	15,1
Andere	0,1

### Verlauf der Anlageklassengewichtungen

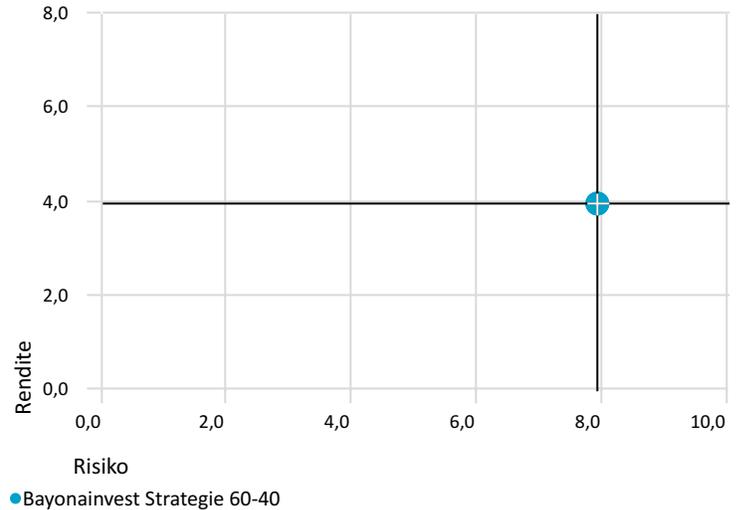


### Statistische Daten

Zeitraum: 02.03.2013 bis 30.06.2024

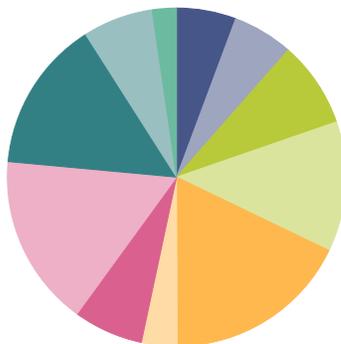
Rendite p.a.	3,94%
Standardabweichung	7,92%
Max. Verlust	-16,09%
Korrelation	—
Sharpe Ratio	0,09

### Rendite-Risiko Diagramm



### Aktien - Branchenverteilung

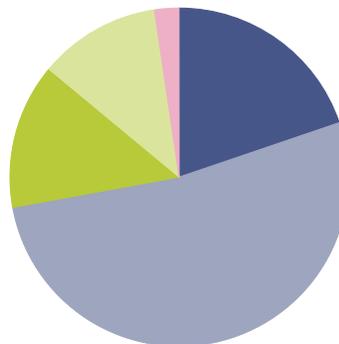
Portfolio-Datum: 30.06.2024



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