

## ARIAD Active Allocation Strategie

### Zuverlässiger Risikopuffer für Ihr Portfolio

Nur für Vertriebspartner

Seite 1/2

### AUF EINEN BLICK

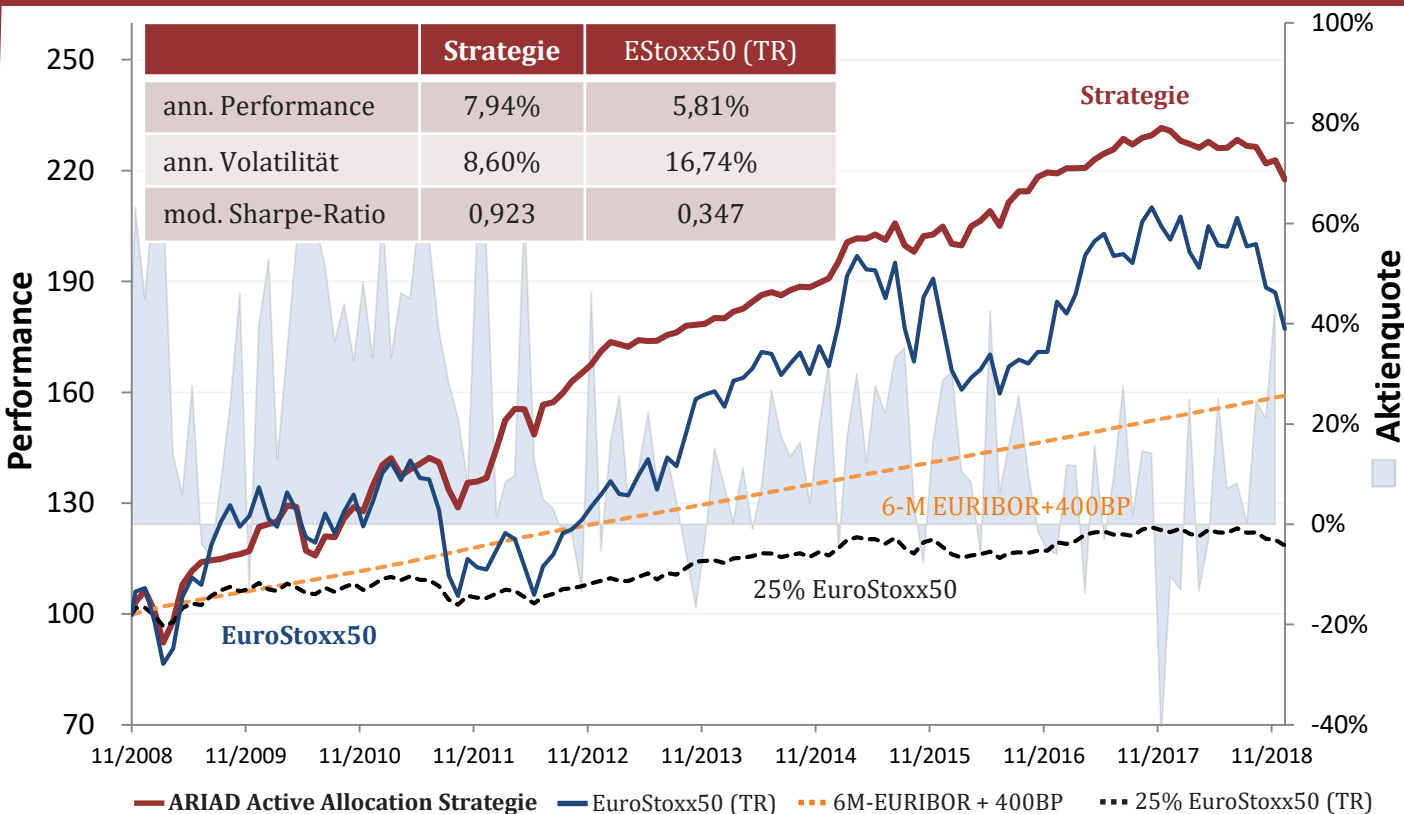
Die ARIAD Active Allocation Strategie zielt darauf ab, **jährlich eine attraktive Mindestrendite** zu erzielen – bei einer vergleichsweise **äußerst niedrigen Volatilität** (seit 11/2008 erfolgreich umgesetzt). Im Fokus der Strategie stehen deshalb:

- **Kapitalerhalt:** Risiko-averses Management, z.B. keine Beimischung weiterer Assetklassen neben Aktien
- **Laufende Rendite:**
  - Mindestrendite:** Absolute-Return-Ziel (6M-EURIBOR+400BP)
  - Aktienrendite:** Relatives Performance-Ziel (25% EStoxx50)
- **Verantwortung:** Wir übernehmen 100% Performance-Verantwortung durch Aktien-Index-Quotensteuerung - „wann“, „wieviel“ und „worin“ investieren (EStoxx50, S&P500, NIKKEI225)

### ANLAGESTRATEGIE

- Konzentration auf renditestarke **Assetklasse Aktien** (über die Indizes: EStoxx50, S&P500, NIKKEI225)
- **Aktien-Index-Quotensteuerung**
  - Keine Aktienselektion
  - Aktienquote bewegte sich historisch zwischen +60% und – 40% (im Durchschnitt ca +20%)
- Einer umfassenden **Makroanalyse** der Märkte:
  - 12 Scoring-Parameter in 3 verschiedenen Kategorien
  - u.a. Makro-ökonomischer US-Zyklus, Zinszyklus, Marktpsychologie, marktbeeinflussende Themen
- **Regelgebundenes Risikomanagement** in Abhängigkeit von der Performance (Flexibles Risiko-Budget)
- Einsatz hochliquider börsennotierter **Aktien-Futures&Optionen** ermöglichen uns, in jeder Marktphase (steigend, fallend oder seitwärts tendierend) eine solide Rendite zu erwirtschaften
- Management-Ziele:
  - **Jährliche Mindestrendite** erzielen: Absolute-Return-Ziel (6M-EURIBOR+400BP)
  - Zusätzlich **Partizipation an Hausse-Phasen:** Relatives Performance-Ziel (25% EuroStoxx50)

### MEHRWERT DURCH AKTIENQUOTENSTEUERUNG



# ARIAD Active Allocation Strategie

## Zuverlässiger Risikopuffer für Ihr Portfolio

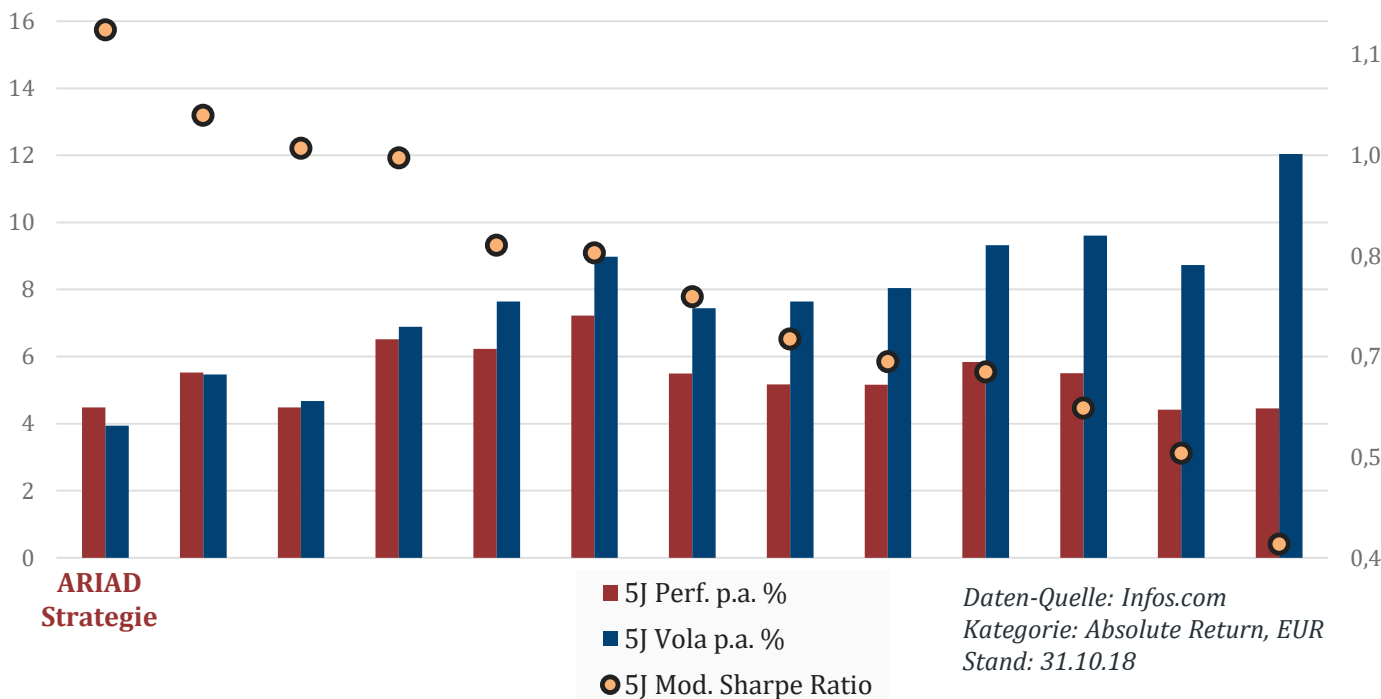
Nur für Vertriebspartner

Seite 2/2

### VORTEILE DER STRATEGIE

- Die **duale Benchmark** (absolutes und relatives Performanceziel) garantiert messbare Anlageerfolge auf zwei Ebenen: angestrebte jährliche Mindestrendite und Partizipation an Aktien-Hausse-Phasen
- Hochliquide Aktien-Futures&Optionen** ermöglichen, von allen Marktphasen zu profitieren
- Fokussierung auf die **renditestarke Assetklasse Aktien**, keine Beimischung von Risiken weiterer Assetklassen
- Investition nur in **Aktien-Indizes** (EStoxx50, S&P500, NIKKEI225) vermeidet Aktienselektionsrisiko
- Wird seit November 2008 **erfolgreich in verschiedenen Spezial- und Publikumsfonds** umgesetzt

### Peergroup-Vergleich (Top Absolute Return Strategien nach 5J-Performance)



### ÜBER ARIAD ASSET MANAGEMENT GMBH

ARIAD Asset Management wurde 2002 als quantitativ orientierter Vermögensverwalter für institutionelle und private Investoren gegründet. Seit jeher steht **Kapitalerhalt im Fokus unserer Anstrengungen**. Nicht nur, um große Vermögen von Industrieunternehmen, Stiftungen und Pensionskassen langfristig zu erhalten und zu mehren, sondern, weil wir davon überzeugt sind, dass wir mit diesem Ansatz den Interessen unserer Kunden am besten dienen können.

### WEITERE INFORMATIONEN

Die ARIAD Active Allocation Strategie wird **seit dem 01.02.16 auch in Publikumsfonds** der Monega KAG umgesetzt. Weitere Informationen erhalten Sie auf unserer Website unter [www.ariad.de](http://www.ariad.de)

### RECHTLICHE INFORMATIONEN

**© Copyright**  
Dieses Werk ist urheberrechtlich geschützt. Die dadurch begründeten Rechte, insbesondere die der Übersetzung, des Nachdrucks, des Vortrags, der Entnahme von Abbildungen und Tabellen, der Funksendung, der Mikroverfilmung oder der Vervielfältigung auf anderen Wegen und der Speicherung in Datenverarbeitungsanlagen, bleiben, auch bei nur auszugsweiser Verwertung, vorbehalten. Eine Vervielfältigung dieses Werkes oder von Teilen dieses Werkes ist auch im Einzelfall nur in den Grenzen der gesetzlichen Bestimmungen des Urheberrechtsgesetzes der Bundesrepublik Deutschland vom 9. September 1965 in der jeweils gültigen Fassung zulässig. Zuwiderhandlungen können den Strafbestimmungen des Urheberrechtsgesetzes unterliegen.

**Haftungsausschluss**  
Die Informationen in dieser Broschüre wurden aus Daten erarbeitet, von deren Richtigkeit ausgegangen wurde; wir übernehmen jedoch weder Haftung noch irgendeine Garantie. Die Broschüre darf nicht als Verkaufsangebot oder als Aufforderung zur Abgabe eines Angebots zum Kauf von Wertpapieren verstanden werden. Die in der Broschüre gemachten Aussagen können ohne Vorankündigung geändert werden.

**Herausgeber:** ARIAD Asset Management GmbH, Hohe Bleichen 13, 20354 Hamburg