

METHODIK: WANN WIRD EIN FONDS ZUM TOPFONDS?

Ganzheitlicher Prozess unter Berücksichtigung sämtlicher relevanter Faktoren

- Unser Leitfaden: Unabhängigkeit von Produktgebern

Qualität der Fonds steht im Fokus

- Welchen Mehrwert liefert der Fonds?
- Sind die erzielten Ergebnisse systemisch oder zufällig?
- Sind die Ergebnisse reproduzierbar?
- Wie werden Risiken gemanagt?

RAHMENPARAMETER

Mindestalter 3 Jahre, Mindestvolumen 20 Mio. EUR, Mifid II Konformität, Kosten

QUANTITATIVE PARAMETER

QUALITATIVE KRITERIEN

Performance:

Überdurchschnittlich

Fondsebene:

Z.B. Philosophie und Strategie

Managerleistung:

Stabiles Alpha zur Vergleichsgruppe

Fondsmanagement:

Z.B. Qualifikation und Investmentprozesse

Langfristige Ertragskraft:

Adäquates Bullen-Beta, Betadifferenz > 0

Risikomanagement:

Z.B. Investmentrisiken, Risikovorgaben & -kontrolle, Personenrisiken, Unternehmensrisiken

Risiko:

Unterdurchschnittliche Volatilität

Unterdurchschnittlicher MDD

Bärenbeta < 1

Portfoliobeitrag:

Niedrige und stabile Korrelationen

Handelbarkeit auf gängigen Plattformen, Bestandsprovisionen

TopFonds Liste mit Dauerbrennern und Newcomern