

Auswertungstichtag: 30.06.2021

12 Monate



Muster-Vermögensverwaltung

VV-ID: 0000.*

firstfive Kunden-Nr.	Risiko- klasse	Performance-Kennzahlen						Risiko-Kennzahlen												Rendite-Kennzahlen								
		Sharpe Ratio			Omega			Risiko % p.a.			Schiefe			Wölbung			Value at Risk %			Ø Verlust % p.M.			absolute Rendite %			Ø Gewinn % p.M.		
		1)	2)	3)	1)	2)	3)	1)	2)	3)	1)	2)	3)	1)	2)	3)	1)	2)	3)	1)	2)	3)	1)	2)	3)			
0001M6	II	0,04	**	39	1,25	**	41	2,92	**	48	-0,40	***	31	-0,75	***	29	4,94	**	36	0,28	**	37	0,80	**	38	0,35	**	33
0002M6	III	0,82	**	40	1,96	**	41	5,44	*	65	-0,59	*	55	-0,77	*	49	8,41	*	51	0,45	*	51	5,18	***	29	0,88	*****	7
0003M6	IV	0,74	*	36	1,84	*	37	5,94	***	26	-0,07	***	23	-1,36	***	20	8,56	**	28	0,51	**	29	5,10	*	36	0,94	*	33
0006M6	IV	1,08	***	23	2,40	***	21	6,01	***	27	-0,19	**	32	-0,97	**	30	8,27	**	25	0,42	***	20	7,17	**	25	1,02	***	23
0005M6	IV	0,60	*	39	1,63	*	39	7,57	*	41	-0,60	*	40	-1,07	**	26	12,30	*	40	0,71	*	41	5,27	*	35	1,17	****	10
0004M6	V	0,82	**	15	1,82	**	16	8,30	***	10	-0,57	*	19	-1,21	**	14	12,99	***	12	0,77	**	16	7,47	**	15	1,39	**	14
Durchschnitt	II	0,59			1,74			2,51			-0,29			-0,68			3,81			0,22			1,88			0,38		
Durchschnitt	III	1,02			2,25			4,22			-0,16			-1,01			5,85			0,32			4,83			0,72		
Durchschnitt	IV	1,16			2,43			6,12			-0,06			-1,18			8,17			0,45			7,72			1,09		
Durchschnitt	V	1,18			2,15			8,65			-0,11			-1,04			12,01			0,70			11,45			1,50		

1) Wert, s.a. Glossar im Quartalsbericht 2) Leistung ausgedrückt in Qualitätssternen (maximal *****) 3) Platzziffer

Auswertungstichtag: 30.06.2021

24 Monate



Muster-Vermögensverwaltung

VV-ID: 0000.*

firstfive Kunden-Nr.	Risiko- klasse	Performance-Kennzahlen						Risiko-Kennzahlen												Rendite-Kennzahlen								
		Sharpe Ratio			Omega			Risiko % p.a.			Schiefe			Wölbung			Value at Risk %			Ø Verlust % p.M.			absolute Rendite %			Ø Gewinn % p.M.		
		1)	2)	3)	1)	2)	3)	1)	2)	3)	1)	2)	3)	1)	2)	3)	1)	2)	3)	1)	2)	3)	1)	2)	3)			
0001M6	II	0,84	*	41	2,23	*	41	2,40	****	20	-0,55	*	40	0,38	*	38	3,56	***	26	0,17	***	27	5,14	*	41	0,38	*	40
0002M6	III	2,05	*****	5	4,29	****	13	5,19	**	45	-0,58	*	51	-0,34	*	43	6,29	**	35	0,27	***	24	23,60	*****	5	1,17	*****	5
0003M6	IV	1,58	****	10	3,00	***	18	6,36	****	15	-0,24	**	29	-0,92	****	14	8,03	***	18	0,43	***	19	22,32	***	21	1,29	**	24
0006M6	IV	1,86	*****	4	3,68	*****	6	6,23	****	12	-0,33	*	32	-0,77	***	19	7,55	****	15	0,36	****	8	25,72	*****	7	1,34	***	19
0005M6	IV	1,44	***	19	2,58	**	28	6,96	***	23	-0,69	*	38	-0,71	**	25	9,88	**	30	0,54	**	28	22,13	***	22	1,40	***	16
0004M6	V	1,97	*****	4	3,63	****	8	7,74	*****	2	-0,59	*	25	-0,44	**	16	9,70	****	9	0,48	****	8	34,10	****	9	1,73	***	15
Durchschnitt	II	1,49			3,38			2,74			-0,04			-0,13			3,25			0,16			9,56			0,55		
Durchschnitt	III	1,59			3,20			4,82			0,09			-0,50			5,69			0,30			16,74			0,95		
Durchschnitt	IV	1,45			2,83			7,02			0,03			-0,76			8,65			0,47			22,12			1,33		
Durchschnitt	V	1,54			2,97			10,15			0,25			-0,32			11,40			0,63			36,74			1,87		

1) Wert, s.a. Glossar im Quartalsbericht 2) Leistung ausgedrückt in Qualitätssternen (maximal *****) 3) Platzziffer

Auswertungstichtag: 30.06.2021

36 Monate



Muster-Vermögensverwaltung

VV-ID: 0000.*

firstfive Kunden-Nr.	Risiko- klasse	Performance-Kennzahlen						Risiko-Kennzahlen												Rendite-Kennzahlen								
		Sharpe Ratio			Omega			Risiko % p.a.			Schiefe			Wölbung			Value at Risk %			Ø Verlust % p.M.			absolute Rendite %			Ø Gewinn % p.M.		
		1)	2)	3)	1)	2)	3)	1)	2)	3)	1)	2)	3)	1)	2)	3)	1)	2)	3)	1)	2)	3)	1)	2)	3)			
0001M6	II	0,18	*	37	1,65	**	33	2,43	*****	11	-0,74	**	26	0,55	***	20	3,99	****	14	0,20	****	16	4,74	*	39	0,33	*	42
0003M6	IV	-0,02	**	26	1,12	**	26	9,93	***	21	-1,04	**	21	1,81	***	18	18,31	**	21	1,01	**	24	2,81	**	26	1,13	**	24
0006M6	IV	-0,09	*	30	1,07	*	30	10,72	**	27	-1,27	**	24	1,84	***	20	20,53	**	27	1,10	*	28	0,90	*	30	1,18	***	18
0002M6	IV	0,26	****	12	1,40	****	13	6,85	*****	1	-0,87	***	17	0,39	****	10	11,92	*****	6	0,65	*****	2	9,01	***	16	0,91	*	33
0004M6	V	0,08	***	17	1,19	***	18	12,41	****	11	-1,17	*	26	1,96	***	17	22,91	***	17	1,27	**	19	6,53	***	17	1,51	**	21
0005M6	V	-0,36	*	26	0,92	*	29	11,64	*****	4	-0,81	**	21	0,44	****	9	21,96	***	14	1,37	**	21	-5,92	*	27	1,26	*	28
Durchschnitt	II	0,80			2,14			3,73			-0,51			1,00			5,51			0,27			11,48			0,59		
Durchschnitt	III	0,45			1,62			6,83			-0,65			1,50			10,75			0,56			12,43			0,90		
Durchschnitt	IV	0,16			1,29			9,98			-0,79			1,89			17,18			0,92			8,45			1,19		
Durchschnitt	V	0,10			1,29			14,32			-0,53			1,66			23,66			1,32			13,33			1,70		

1) Wert, s.a. Glossar im Quartalsbericht 2) Leistung ausgedrückt in Qualitätssternen (maximal *****) 3) Platzziffer

Auswertungstichtag: 30.06.2021

60 Monate



Muster-Vermögensverwaltung

VV-ID: 0000.*

firstfive Kunden-Nr.	Risiko- klasse	Performance-Kennzahlen						Risiko-Kennzahlen												Rendite-Kennzahlen								
		Sharpe Ratio			Omega			Risiko % p.a.			Schiefe			Wölbung			Value at Risk %			Ø Verlust % p.M.			absolute Rendite %			Ø Gewinn % p.M.		
		1)	2)	3)	1)	2)	3)	1)	2)	3)	1)	2)	3)	1)	2)	3)	1)	2)	3)	1)	2)	3)	1)	2)	3)			
0001M6	IV	0,17	****	8	1,58	****	7	6,94	*****	2	-1,09	**	16	3,23	*	21	11,93	*****	2	0,51	*****	1	18,00	****	9	0,80	*	26
0006M6	IV	0,24	****	6	1,44	****	10	10,34	**	18	-1,22	**	18	1,63	****	10	18,49	**	17	0,97	**	16	25,56	****	6	1,39	*****	3
0002M6	IV	0,28	****	5	1,52	****	8	9,62	***	15	-0,68	****	6	2,10	***	15	15,70	***	11	0,84	***	11	26,69	*****	3	1,27	****	6
0003M6	V	0,14	****	8	1,34	****	8	10,38	*****	1	-0,93	**	18	0,85	****	7	18,27	*****	3	1,02	*****	4	19,65	****	8	1,37	*	20
0004M6	V	0,05	***	10	1,24	***	12	12,28	***	11	-0,87	**	17	1,12	****	9	21,76	***	13	1,25	**	19	14,99	***	10	1,55	***	10
0005M6	V	0,03	***	14	1,21	***	14	11,65	****	8	-0,82	***	12	0,30	*****	4	20,75	****	8	1,24	**	18	13,14	***	14	1,50	***	12
Durchschnitt	II	0,30			1,78			3,97			-0,67			1,67			6,25			0,31			15,30			0,56		
Durchschnitt	III	0,14			1,43			6,71			-0,98			1,84			11,35			0,59			14,74			0,85		
Durchschnitt	IV	0,03			1,26			9,74			-1,00			2,48			17,25			0,91			13,44			1,15		
Durchschnitt	V	-0,03			1,25			12,90			-0,68			1,67			21,80			1,23			17,90			1,54		

1) Wert, s.a. Glossar im Quartalsbericht 2) Leistung ausgedrückt in Qualitätssternen (maximal *****) 3) Platzziffer