

100% MSCI World – oder selber mischen?

Fondsplattform, März 2022

Markus Kaiser



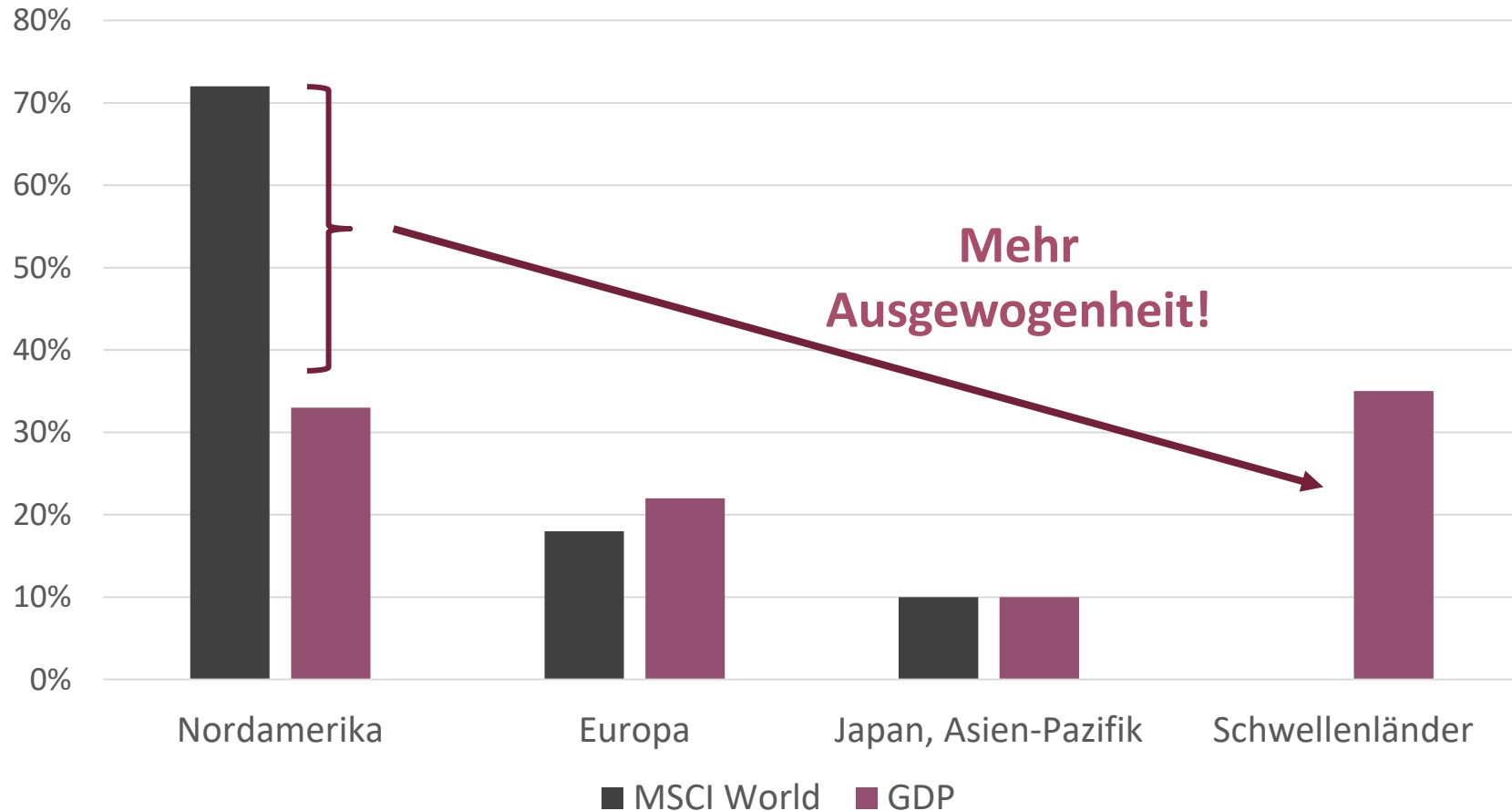
100% MSCI World – oder selber mischen?

- MSCI World hat sich langfristig bewährt
- MSCI World ist ein gutes Basisinvestment und der Sparplanklassiker
- Gewichtung nach Marktkapitalisierung ist Fluch und Segen



Selber mischen für mehr Ausgewogenheit

Alternativ: Weltportfolio nach Wirtschaftsleistung



Weltportfolio mit klassischen ETFs

| ETF | Nordamerika | Europa | Japan, Asien-Pazifik | Schwellen- länder | Titel im Index | Kosten p.a. ab |
|---------------------------|-------------|--------|-------------------------|----------------------|-------------------|-------------------|
| FTSE North America ETF | ✓ | | | | 660 | 0,10% |
| Stoxx Europe 600 ETF | | ✓ | | | 600 | 0,07% |
| MSCI Pacific ETF | | | ✓ | | 400 | 0,45% |
| MSCI Emerging Markets ETF | | | | ✓ | 1.000 | 0,10% |

Weltportfolio mit klassischen ETFs + Small Caps

| ETF | Nordamerika | Europa | Japan, Asien-Pazifik | Schwellenländer | Titel im Index | Kosten p.a. ab |
|---------------------------|-------------|--------|----------------------|-----------------|----------------|----------------|
| FTSE North America ETF | ✓ | | | | 660 | 0,10% |
| Stoxx Europe 600 ETF | | ✓ | | | 600 | 0,07% |
| MSCI Pacific ETF | | | ✓ | | 400 | 0,45% |
| MSCI Emerging Markets ETF | | | | ✓ | 1.000 | 0,10% |
| | | | | | | |
| MSCI World Small Caps ETF | ✓ | ✓ | ✓ | | 3.500 | 0,35% |
| MSCI EM Small Caps ETF | | | | ✓ | 1.800 | 0,55% |

Small Caps blieben zuletzt zurück

Kursentwicklung, Chartvergleich



Quelle: Daten von extra ETF

Angaben zur bisherigen Wertentwicklung erlauben keine Prognose für die Zukunft.

Weltportfolio mit Faktor ETFs

| ETF | Nordamerika | Europa | Japan, Asien-Pazifik | Schwellen- länder | Titel im Index | Kosten p.a. ab |
|-------------------------|-------------|--------|-------------------------|----------------------|-------------------|-------------------|
| MSCI World Momentum ETF | ✓ | ✓ | ✓ | | 360 | 0,25% |
| MSCI World Quality ETF | ✓ | ✓ | ✓ | | 310 | 0,25% |
| MSCI World Value ETF | ✓ | ✓ | ✓ | | 425 | 0,25% |
| MSCI World Low Vol ETF | ✓ | ✓ | ✓ | | 310 | 0,25% |
| EM Multi Factor ETF | | | | ✓ | 380 | 0,45% |

Einsatz von Faktor-ETFs

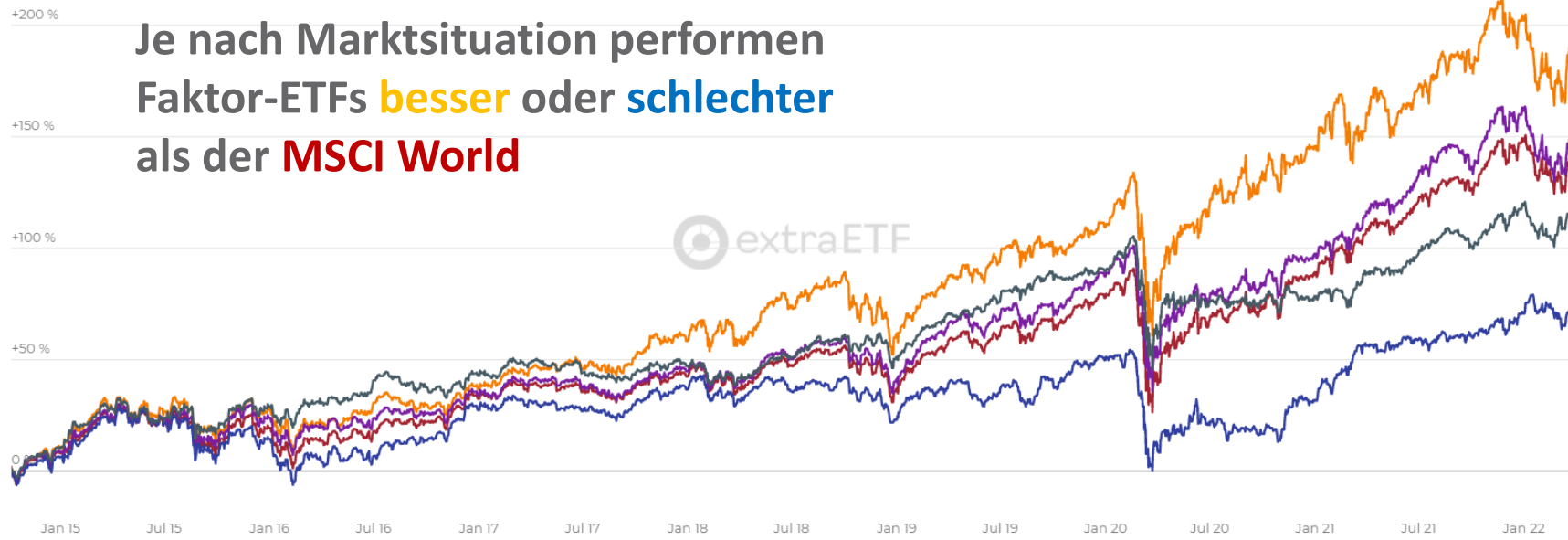
Kursentwicklung, Chartvergleich

Kurs (NAV) | Kurs inkl. Ausschüttung | Fondsvolumen | Anzahl Fondsanteile

NAV ⚙️

☰ 1m 3m 6m YTD 1y 3y 5y Seit Vergleich Max

Von 07. Okt. 2014 Bis 25. Mär. 2022



Quelle: Daten von extra ETF

de.extraetf.com

Angaben zur bisherigen Wertentwicklung erlauben keine Prognose für die Zukunft.

Weltportfolio mit ETFs + Nachhaltigkeitskriterien

| ETF | Nordamerika | Europa | Japan, Asien-Pazifik | Schwellen- länder | Titel im Index | Kosten p.a. ab |
|------------------------------|-------------|--------|-------------------------|----------------------|-------------------|-------------------|
| ISHARES MSCI WORLD SRI-EUR-A | ✓ | ✓ | ✓ | | 373 | 0,20% |
| AMUNDI INDEX MSCI USA SRI | ✓ | | | | 136 | 0,18% |
| AMUNDI INDEX MSCI EUROPE SRI | | ✓ | | | 121 | 0,18% |
| UBS ETF MSCI PACIFIC SRI ACC | | | ✓ | | 103 | 0,40% |
| X ESG MSCI EMERGING MARKETS | | | | ✓ | 352 | 0,25% |
| UBS ETF MSCI CHINA ESG USDD | | | | ✓ | 545 | 0,45% |

Nachhaltigkeit zahlt sich aus!

Kursentwicklung, Chartvergleich



Quelle: Daten von extra ETF

de.extraetf.com

Angaben zur bisherigen Wertentwicklung erlauben keine Prognose für die Zukunft.

Passives Weltportfolio + aktiver Investmentprozess

Partizipation
an den Erträgen der Weltwirtschaft

1. Weltweite Risikostreuung

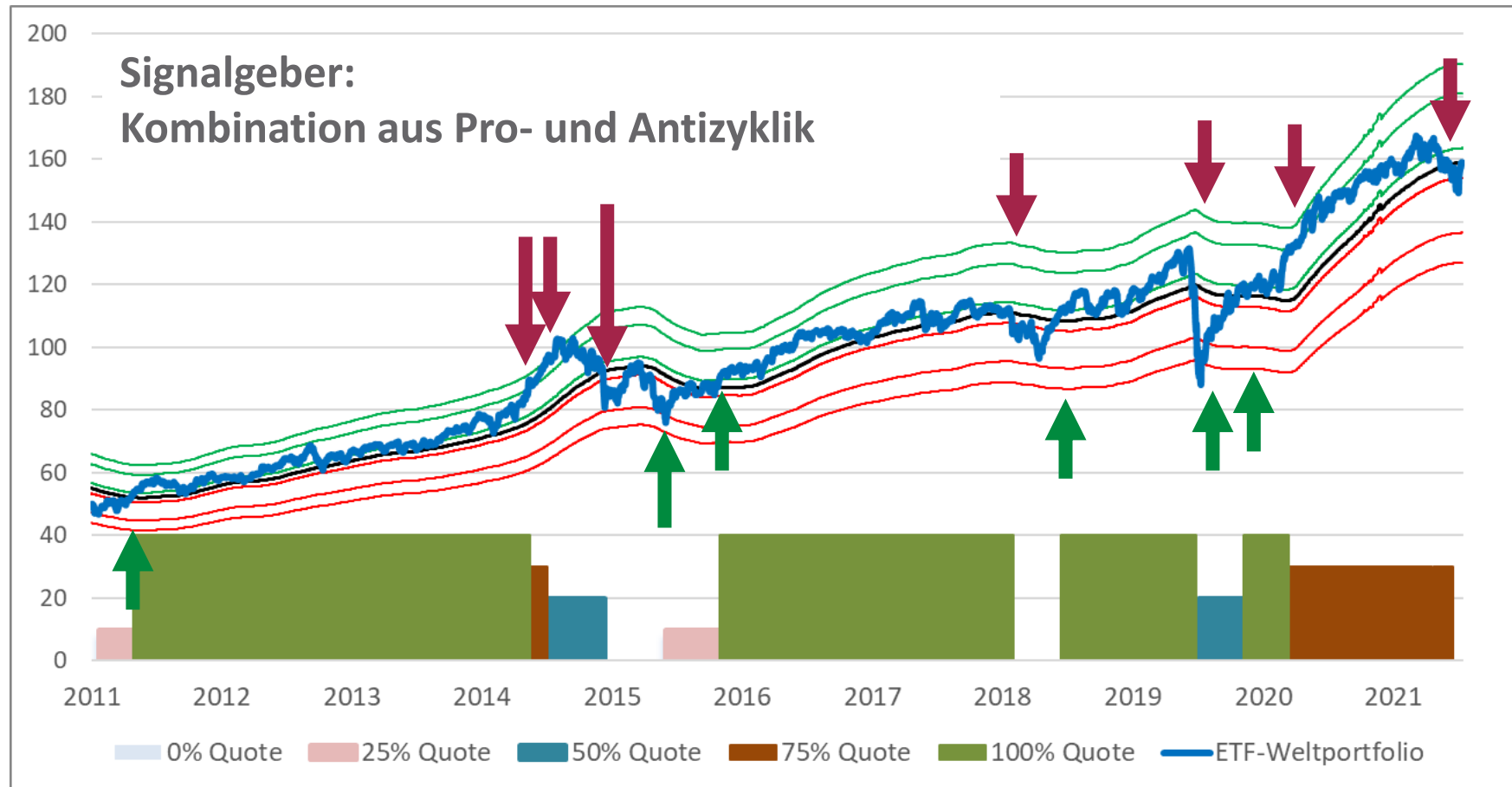
3. Rebalancing

2. Kostengünstige ETFs

4. Risikobegrenzung

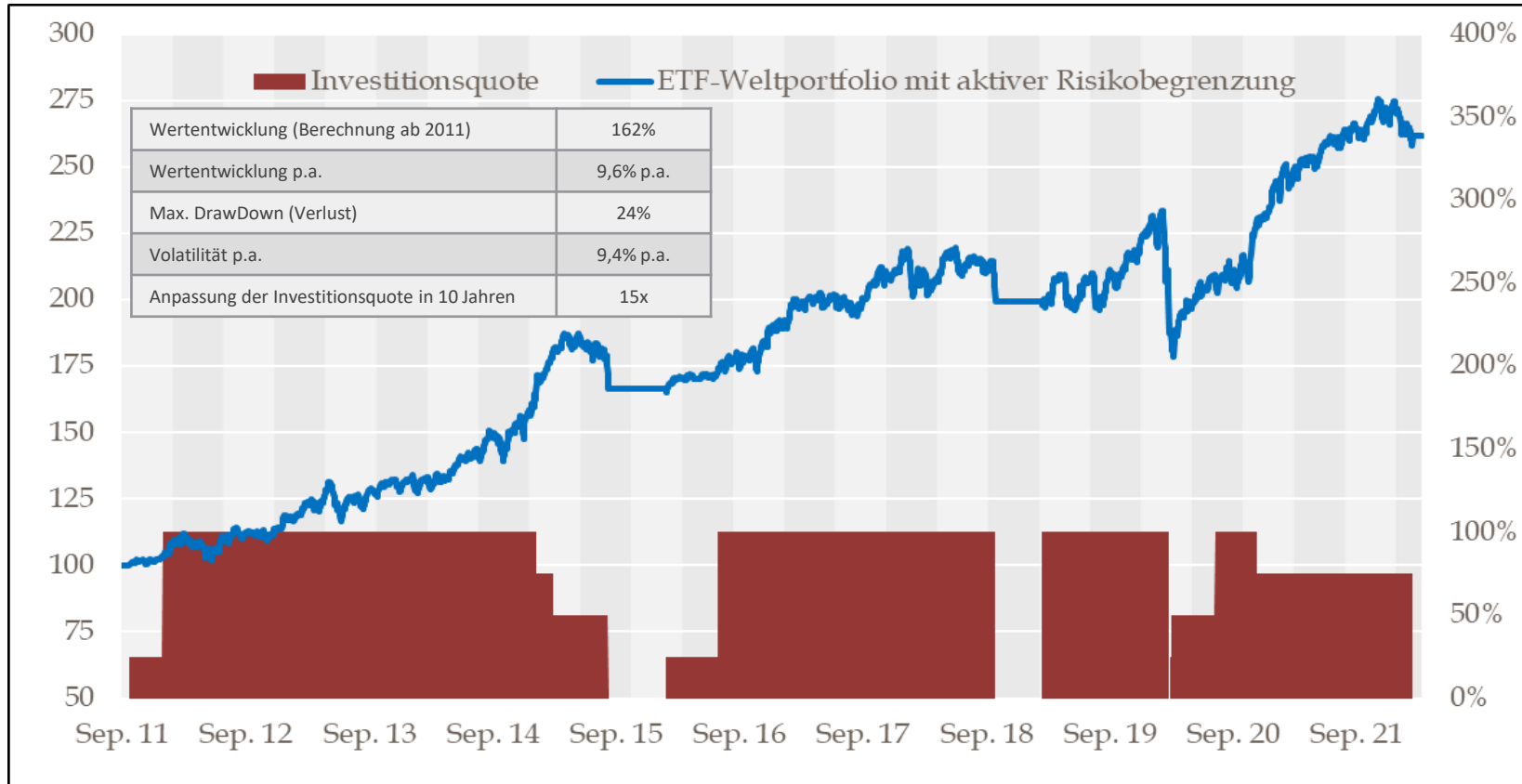
„Strategisch allokkieren – taktisch korrigieren“

Simulation: ETF-Weltportfolio mit aktiver Risikobegrenzung



Quelle: Berechnungen und Daten Greiff capital management AG, Berechnungen und Simulation ohne Kosten für aktives Management.
Angaben zur bisherigen Wertentwicklung erlauben keine Prognose für die Zukunft.

Simulation: ETF-Weltportfolio mit aktiver Risikobegrenzung



Quelle: Berechnungen und Daten Greiff capital management AG, Berechnungen und Simulation ohne Kosten für aktives Management.
Angaben zur bisherigen Wertentwicklung erlauben keine Prognose für die Zukunft.

Unser Angebot: Aktive Anlagestrategien mit ETFs



PRIMA Kapitalaufbau TR (ISIN: LU0944781623)

Weltweiter Vermögensverwaltender ETF-Dachfonds mit Fokus auf Nachhaltigkeit



Patriarch Vermögensmanagement B (ISIN: LU0944781623)

Weltweiter Aktien ETF-Dachfonds mit regelbasierter Trend200 Risikosteuerung



PatriarchSelect ETF-Trend200 VV

Weltweite Aktien ETF-Vermögensverwaltung mit regelbasierter Trend200 Risikosteuerung

Erfahrenes Team für regelbasierte ETF-Strategien



MARKUS KAISER

- seit 2021 Geschäftsführer Greiff Research Institut GmbH
- 2013 - 2020 Vorstand und Fondsmanager regelbasierte Strategien bei der StarCapital AG
- 2001 - 2013 Geschäftsführer und Fondsmanager bei Veritas Investment GmbH
- 2000 - 2001 Portfoliomanager und technischer Analyst bei PEH Wertpapier AG
- 1997 - 2000 Portfoliomanager und technischer Analyst bei OCM Vermögensverwaltung GmbH
- Studium der Volkswirtschaftslehre, Abschluss Diplom-Vermögensmanager (DIA)



ANDREAS KRAUSS

- seit 2021 Portfoliomanager Greiff capital management AG
- 2013 - 2020 Portfoliomanager bei der StarCapital AG
- 2011 - 2013 Risikomanager auf Produkt- und Gesellschaftsebene bei der Veritas Investment GmbH
- 2009 - 2010 Betreuung der Publikumsfonds bei Helaba Invest Kapitalanlagegesellschaft mbH
- 2005 - 2009 Teamleitung Depotbankservice bei Société Générale S.A.
- Ausbildung zum Bankkaufmann

Presse



Auszeichnungen



Disclaimer

Dieses Dokument richtet sich ausschließlich an Kunden der Kundengruppe „Professionelle Kunden“ gem. § 31 a Abs. 2 WpHG und/oder „Geeignete Gegenparteien“ gem. § 31 a Abs. 4 WpHG und ist nicht für Privatkunden bestimmt. Die Verteilung an Privatkunden ist nicht beabsichtigt. Es dient ausschließlich Informationszwecken und stellt keine Finanzanalyse im Sinne des §34b WpHG, keine Anlageberatung, Anlageempfehlung oder Aufforderung zum Kauf oder Verkauf von Finanzinstrumenten dar. Historische Wertentwicklungen lassen keine Rückschlüsse auf ähnliche Entwicklungen in der Zukunft zu. Diese sind nicht prognostizierbar. Alleinige Grundlage für den Anteilerwerb sind die Verkaufsunterlagen zum Sondervermögen. Alle angegebenen Daten sind vorbehaltlich der Prüfung durch die Wirtschaftsprüfer zu den jeweiligen Berichtsterminen. Die Ausführungen gehen von unserer Beurteilung der gegenwärtigen Rechts- und Steuerlage aus. Die aufgeführten Auszeichnungen können sich auch nur auf einzelne Anteilsklassen beziehen. Für die Richtigkeit der hier angegebenen Informationen übernimmt Greiff capital management AG keine Gewähr. Änderungen vorbehalten. Quellen: eigene Berechnungen.

Wertentwicklungen der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.

Stand: März 2022