

Deutsche Aktien **Systematic Invest**



FinanzInstitut

Vermögensverwaltung

ÜBER DIE GFA VERMÖGENSVERWALTUNG

Die GFA Vermögensverwaltung GmbH ist ein Spezialist für die Entwicklung regelbasierter Anlagestrategien.

Unsere systematischen Anlagestrategien überzeugen durch ihr ausgezeichnetes Chance/Risiko-Profil.

Übergeordnet verfolgen wir das Ziel, an den Aufwärtstrends der Märkte möglichst vollumfänglich zu partizipieren und dabei gleichzeitig Risiken so weit wie möglich zu begrenzen.

DEUTSCHE AKTIEN **SYSTEMATIC INVEST**

Die Anlagestrategie

Beim **Deutsche Aktien Systematic Invest** handelt es sich um eine flexible und aktienorientierte Strategie, die sich auf Aktien aus den vier wichtigsten deutschen Aktienindizes DAX, MDAX, SDAX und TecDAX fokussiert. Seit Dezember 2014 wird die Strategie als wikifolio mit dem Namen „Dt. Aktien-Momentum-Protakt“ umgesetzt und kann unter www.wikifolio.com/de/de/w/de000LS9L1S1 eingesehen werden.

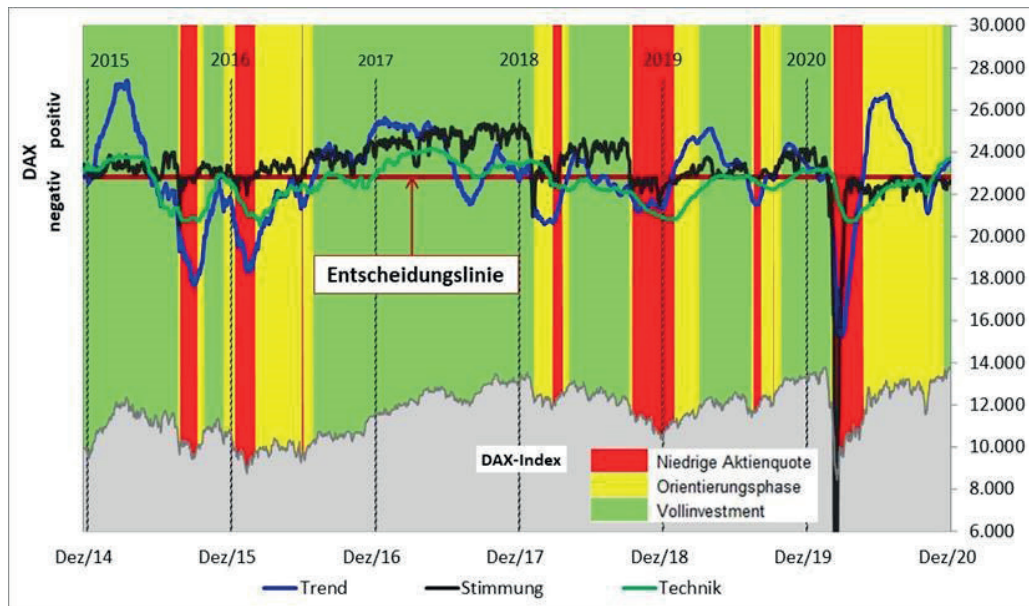
Die Auswahl der Aktien erfolgt rein regelbasiert auf Basis eines in der Praxis bereits seit Dezember 2014 bewährten Handelssystems. Die Steuerung der Aktienquote erfolgt über unsere GFA-Börsenampel[®], deren Signale bereits seit April 2013 veröffentlicht werden.

In das Portfolio aufgenommen werden nur diejenigen Aktien, deren Momentum eine überdurchschnittliche Wertentwicklung erwarten lässt. Das Handelssystem definiert dabei für jede Aktie sowohl den Einstiegszeitpunkt, die Dynamik des Momentums als auch die Marken für die Gewinnsicherung bzw. die Verlustbegrenzung. Die Aktienquote der Strategie beträgt entweder 0 oder 100%.

DEUTSCHE AKTIEN SYSTEMATIC INVEST

Das Risikooverlay

Als Risikooverlay dient die GFA-Börsenampel®, die bereits seit April 2013 unter anderem in der Finanzzeitschrift „Smart Investor“ monatlich veröffentlicht wird. Sie signalisiert zuverlässig, ob die Aktienquote für deutsche Aktien auf 0% reduziert werden sollte oder ob die Quote von 100% voll ausgeschöpft werden kann. Die Ampelphase unserer GFA-Börsenampel® ergibt sich rein mathematisch und regelbasiert aus dem Aggregat verschiedener Indikatoren.



DEUTSCHE AKTIEN **SYSTEMATIC INVEST**

Das Wichtigste im Überblick

- Deutschland-Strategie mit einer Aktienquote von 0 oder 100%
- Rein regelbasierte Anlagestrategie
- Anlageuniversum: Sämtliche Aktien aus DAX, MDAX, SDAX und TecDAX
- Investition in die Titel mit dem höchsten dynamischen Momentum
- **Systematisches Risikomanagement:**
 - Aktienquote 0 oder 100%
 - Gewinnsicherungs-Systematik, u.a. über die GFA-Börsenampel®
 - Gleichgewichtung sämtlicher Einzelwerte bei Neuaufnahme
 - Diversifikation über i.d.R. 20 Einzelwerte zur Reduktion unternehmensspezifischer Risiken und zur Optimierung des Rendite-/Risikoverhältnisses im gesamten Portfolio.
- Praxiserprobt durch track record der Momentumstrategie seit Dezember 2014
- Praxiserprobt durch das Risikooverlay (GFA-Börsenampel®) seit April 2013

DEUTSCHE AKTIEN SYSTEMATIC INVEST

Wertentwicklung



Stand: Ultimo Dezember 2020

DEUTSCHE AKTIEN SYSTEMATIC INVEST - Wertentwicklung

Monats- und Jahresergebnisse

Jahr	JAN	FEB	MRZ	APR	MAI	JUN	JUL	AUG	SEP	OKT	NOV	DEZ	gesamt	DAX
2014												-0,16%*)	-0,16%*)	-0,61%
2015	8,11%	6,71%	1,34%	-4,70%	4,98%	-3,07%	0,70%	-6,75%	-0,11%	4,13%	3,43%	-0,10%	14,42%	9,56%
2016	-6,91%	-0,11%	3,04%	0,02%	2,99%	-3,69%	4,91%	0,22%	5,15%	-3,26%	1,08%	4,89%	7,79%	6,87%
2017	2,57%	1,46%	4,55%	3,19%	5,74%	-1,33%	4,14%	3,34%	7,88%	4,20%	-3,66%	2,48%	39,92%	12,51%
2018	2,69%	-1,22%	-2,68%	0,00%	2,84%	-1,87%	5,21%	4,14%	-6,78%	-9,71%	-0,08%	-0,07%	-8,26%	-18,26%
2019	-0,04%	-1,61%	4,02%	3,35%	-7,44%	9,58	1,60%	-6,33%	-0,94%	1,92%	5,35%	2,67%	11,45%	25,50%
2020	-0,17%	-5,77%	-2,63%	0,90%	0,46%	-0,56%	-0,81%	1,00%	0,11%	-0,97%	2,33%	1,23%	-5,01%	3,55
Bisherige Wertentwicklung zum Ultimo Dezember 2020													58,52%	39,05%

DEUTSCHE AKTIEN **SYSTEMATIC INVEST**

Tagesaktuelle Informationen finden Sie unter

<http://www.gfa-vermoegensverwaltung.de/produkte/zertifikate/>

RECHTLICHE HINWEISE

- Diese Information dient der Produktinformation.
- **Haftungsausschluss:** Die Informationen stellen kein Angebot und keine Aufforderung zum Kauf dar. Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist nicht notwendigerweise ein Hinweis auf zukünftige Ergebnisse. Der Wert von Anlagen und mögliche Erträge hieraus sind nicht garantiert und können sowohl fallen als auch steigen. Es kann daher grundsätzlich keine Zusicherung gegeben werden, dass die Ziele der Anlagepolitik erreicht werden. Darüber hinaus besteht die Möglichkeit, dass die Anleger den von ihnen investierten Betrag nicht vollständig zurückerhalten. Die Strategie kann erhöhte Wertschwankungen aufweisen. D.h. die Anteilspreise können auch innerhalb kurzer Zeiträume erheblichen Schwankungen unterliegen.
- Die Bezugnahme auf ein Zertifikat im Rahmen dieses Dokumentes stellt weder ein Angebot noch eine Aufforderung zur Zeichnung von Anteilen eines solchen Zertifikats dar. Die Entscheidung, Anteile zu zeichnen, sollte auf Grundlage der Informationen getroffen werden, die Sie auf der Homepage des Zertifikateanbieters www.wikifolio.com sowie auf der Homepage des Vermögensverwalters www.gfa-vermoegensverwaltung.de finden.
- Zukünftigen Investoren wird dringend angeraten, ihre eigenen professionellen Berater für die Beurteilung der Risiken, der Anlagestrategie, der steuerlichen Folgen etc. hinzuzuziehen, um die Angemessenheit einer Investition aufgrund ihrer persönlichen Verhältnisse festzulegen. Die steuerliche Behandlung ist im Übrigen auch von den persönlichen Verhältnissen des jeweiligen Anlegers abhängig und kann künftig Änderungen unterworfen sein.
- Das Research und die Analysen in diesem Dokument wurden von der **GFA Vermögensverwaltung GmbH** erhoben; sie können vor der Zusammenstellung dieser Unterlagen durchgeführt worden sein und werden hier lediglich im allgemeinen Zusammenhang dargestellt. In einigen Fällen wurden die Informationen in diesem Dokument von externen Quellen bezogen, die wir zwar für verlässlich halten, für deren Genauigkeit und Vollständigkeit wir jedoch weder Haftung noch irgendeine Garantie übernehmen können. Alle Äußerungen verstehen sich zum Zeitpunkt der Publikation, können sich aber ohne Ankündigung ändern.

DEUTSCHE AKTIEN **SYSTEMATIC INVEST**

Kontakt

GFA Vermögensverwaltung GmbH

Am Marktplatz 1
79336 Herbolzheim

Tel. +49 7643 91419-50
Fax +49 7643 91419-51

info@gfa-vermoegensverwaltung.de
www.gfa-vermoegensverwaltung.de