

Persönlich/Vertraulich

firstfive - Depotleistungsvergleich
Milesi Asset Management AG

Jahresbetrachtung
Stichtag 31.12.2014

Frankfurt am Main, November 2014

Kundennummer
7022M6
31.12.2014



4.5. Renditeentwicklung

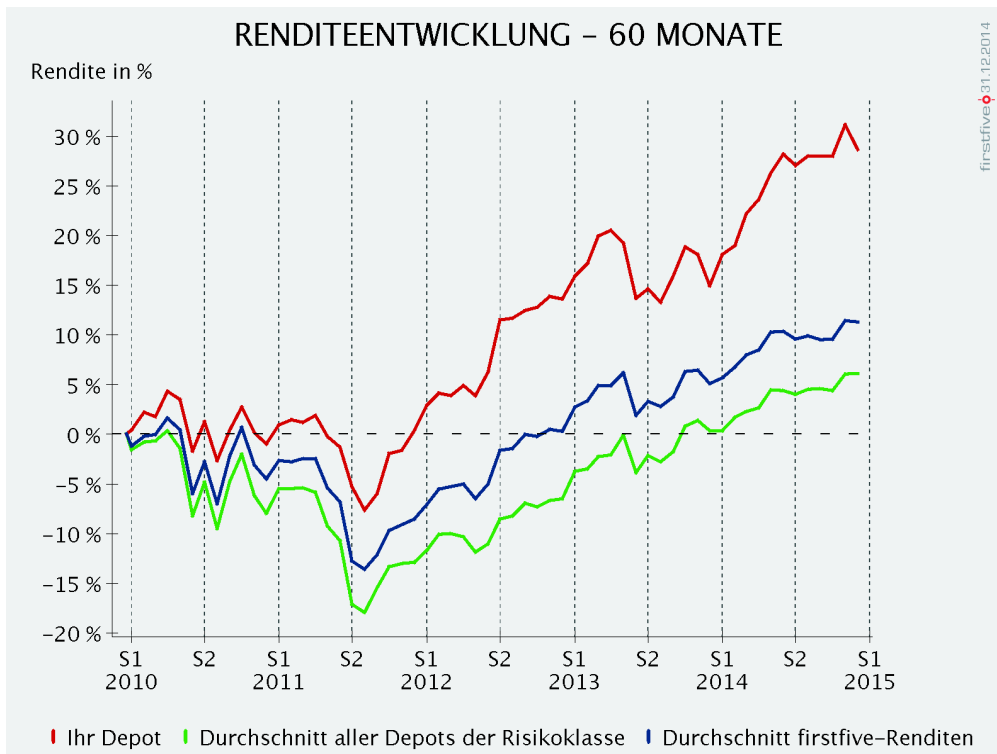


Abb. 16

Renditeentwicklung

Ihr Depot erzielte im 60-Monats-Zeitraum von Ende 12/2009 bis Ende 12/2014 eine Rendite von:

Im Vergleich aller analysierten Depots gleichen Risikoprofils ist Ihr Depot mit diesem Wert sehr gut positioniert.

Es ist demnach festzustellen, dass Ihr Vermögen in Bezug auf die Rendite vergleichsweise gut verwaltet wurde.

Kennzahlen

28,64%

Durchschnittsrendite aller Depots der Risikoklasse III: 6,09%

Durchschnitt der „firstfive Top-Renditen“ der Risikoklasse III: 11,29%



„firstfive Top-Renditen“ in Risikoklasse III (ausgewogen)

Einzeldepots der Banken	Rendite in %	Risiko in %	Sharpe- Ratio
1. Ihr Depot	28,64	7,27	0,70
	24,12	8,64	0,50
	2,01	8,00	0,04
	-9,62	7,56	-0,16
Durchschnitt firstfive-Renditen	11,29	7,87	0,27
Durchschnitt aller Depots	6,09	8,36	0,14

Tabelle 13

Im Berichtszeitraum haben sich bei den von firstfive beobachteten diskretionären Depots Ihrer Risikoklasse Renditeunterschiede von 38,26% ergeben. So erzielten die schlechtesten Vermögensverwalter Renditen von bis zu -9,62%, während die besten Vermögensverwalter Renditen bis zu 28,64% erzielen konnten.

In einer Gesamtbewertung von Rendite und Risiko innerhalb Ihrer Risikoklasse III wird deutlich, dass Ihr Depot im Hinblick auf die Rendite in den letzten 60 Monaten insgesamt vergleichsweise erfolgreich verwaltet wurde. Im Vergleich zu allen Depots in Ihrer Risikoklasse liegt Ihr Depot mit einer Rendite von 28,64% an 1. Stelle und gehört damit zu den „firstfive Top-Renditen“. Dabei war das eingegangene Risiko sehr gering.



Finanzkennzahlen im Überblick: 60 Monate

Risikoklasse III (ausgewogen) Zeitraum: 01.01.2010-31.12.2014

Rendite-Kennzahlen ¹⁾	Ihr Depot			Durchschnitt aller Depots
	Wert	Leistung ¹⁾ (max. 5 Sterne)	Platz	
absolute Rendite (in %)	28,64	★★★★	1	6,09
Gewinnhäufigkeit (in %)	63,33	n.e.	n.e.	58,46
durchschnittl. Gewinn p.M. (in %)	1,08	★★★★	2	0,92

Risiko-Kennzahlen ¹⁾	Ihr Depot			Durchschnitt aller Depots
	Wert	Leistung ¹⁾ (max. 5 Sterne)	Platz	
Risiko p.a. (in %)	7,27	★★★★★	1	8,36
Schiefe	-0,55	★★★★	2	-0,84
Wölbung	0,10	★★★★★	1	1,48
Value at Risk p.a. (in %)	11,51	★★★★★	1	14,96
Verlusthäufigkeit (in %)	36,67	n.e.	n.e.	41,54
durchschnittl. Verlust p.M. (in %)	0,63	★★★★★	1	0,80

Performance-Kennzahlen ¹⁾	Ihr Depot			Durchschnitt aller Depots
	Wert	Leistung ¹⁾ (max. 5 Sterne)	Platz	
Sharpe Ratio	0,70	★★★★	1	0,14
Omega	1,70	★★★★★	1	1,15

1) ► Glossar

Tabelle 16

* Kurzbeschreibung im Glossar

