ARTS

THE ART OF TRADING

boerse-express B2B Roadshow – 10. Oktober 2018

Gunther Pahl, Head of Sales Austria, Head of CEE, Prokurist bei C-QUADRAT Wealth Management GmbH

ARTS

THE ART OF TRADING

Marketingunterlage: Dieses Dokument dient ausschließlich der Information von professionellen Kunden und Vertriebspartnern und richtet sich nicht an Privatkunden.

ARTS
THE ART OF TRADING

Vorstellung

C-Quadrat Investment Group

Das Unternehmen

Das Management-Team der **C-Quadrat Investment Group** in Wien und London.

- Die **C-Quadrat Investment Group** setzt sich aus mehreren unabhängigen Asset Management Unternehmen zusammen, die sowohl auf **quantitative** als auch auf **diskretionäre Absolute und Total Return Strategien** spezialisiert sind.
- Ziel aller Aktivitäten ist **kontinuierliches, flexibles und nachhaltiges Wachstum** für institutionelle Investoren und Privatanleger.
- **Gegründet 1991 in Wien**, ist die C-Quadrat Investment Group heute mit **Büros in Wien, London, Frankfurt, Genf, Zürich, Madrid, Paris und Jerewan** vertreten und in **mehr als 20 Ländern Europas und Asiens aktiv**.
- C-Quadrat ist mit 45% an der ARTS Asset Management GmbH beteiligt.

ARTS Asset Management

Ein Unternehmen der C-QUADRAT Gruppe

Mag. Leo Willert
Eigentümer & Head of Trading
ARTS Asset Management

- **ARTS Asset Management GmbH** ist ein Unternehmen der C-QUADRAT Gruppe und Spezialist für technische trendfolgende Handelssysteme
- **Eigentümergeführtes, privates Unternehmen** – gegründet durch Leo Willert, Jürgen Kultscher, Markus Letschka, Thomas Rieß und Alexander Schütz
- Spezialisiert auf die Verwaltung von Kundengeldern mittels eigener, selbstentwickelter **quantitativer Handelssysteme**
- Erstes Publikumsmandat **seit 27.03.2003**
- Verwaltetes Vermögen **ca. 2,5 Milliarden EUR** (per 31.05.2018) in 17 Fonds
- Eigens entwickelte Datenbank mit **mehr als 10.000 Fonds und ETFs**
- Verarbeitung von ca. 3,5 Millionen Datensätzen pro Monat
- **Fonds im Einsatz:** Belgien, Deutschland, Estland, Italien, Lettland, Litauen, Luxemburg, Österreich, Polen, Rumänien, Schweiz, Slowakei, Slowenien, Spanien, Tschechien, Ungarn

ARTS Asset Management

Das Team

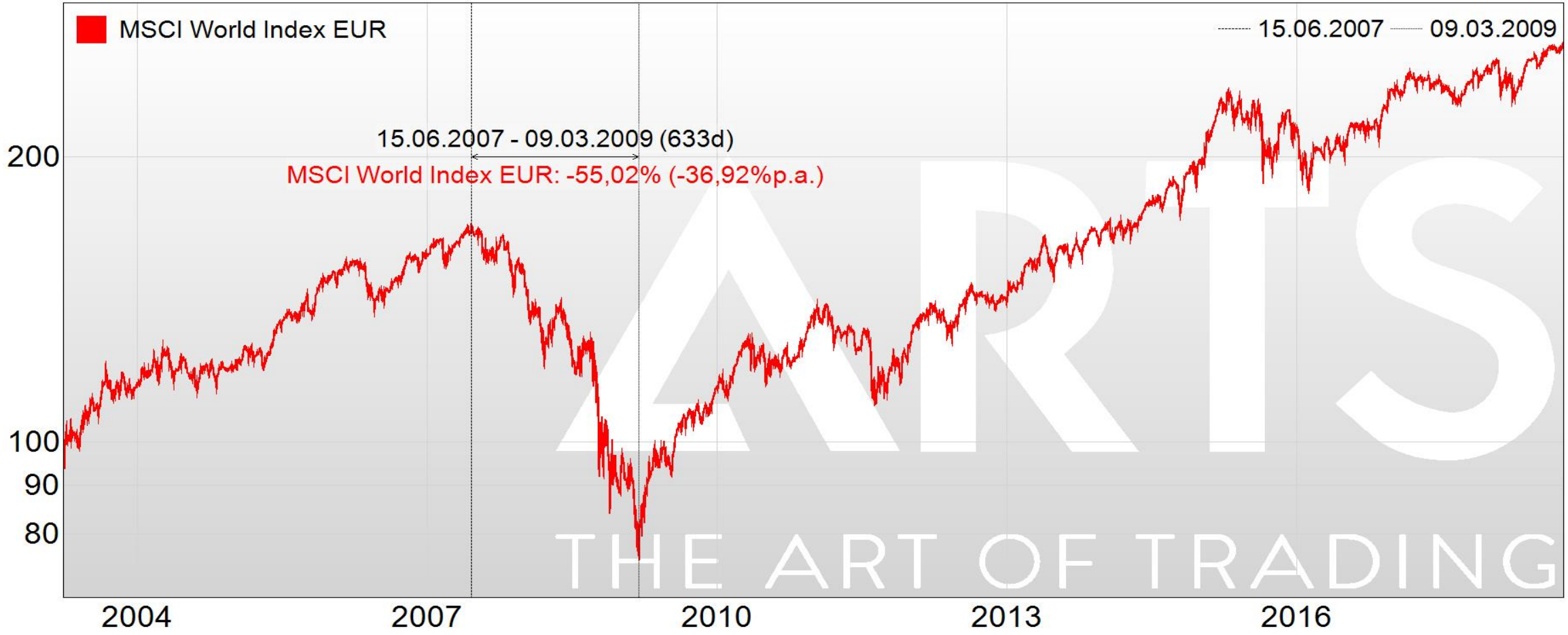
- Für die Entwicklung und Umsetzung technischer Handelssysteme sind **hochkarätige Experten** im Einsatz
- Das Team von ARTS unter der **Leitung von Mag. Leo Willert** besteht aus **langjährig erfahrenen Spezialisten** in der Planung und Konstruktion von hochkomplexen Datenbanken, Finanzmathematikern, Wirtschaftswissenschaftern und Trading-Experten ersten Ranges
- Gemeinsam sind sie für die **Entwicklung** von Handelssystemen, die Programmierung, die **Wartung** der Datenbank, die **Überwachung** der vom System generierten Kauf- und Verkaufssignale, und nicht zuletzt für die permanente **Verfeinerung** und **Optimierung** der Handelssysteme verantwortlich

ARTS
THE ART OF TRADING

Wie sieht es „OHNE“ Flexibilität aus?

Weltaktienmarkt

seit 27.03.2003



Quelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH, Zeitraum: 27.03.2003-30.09.2018, logarithmische Performancedarstellung, Performanceangaben in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

Weltaktienmarkt

seit 27.03.2003

In den nächsten Monaten

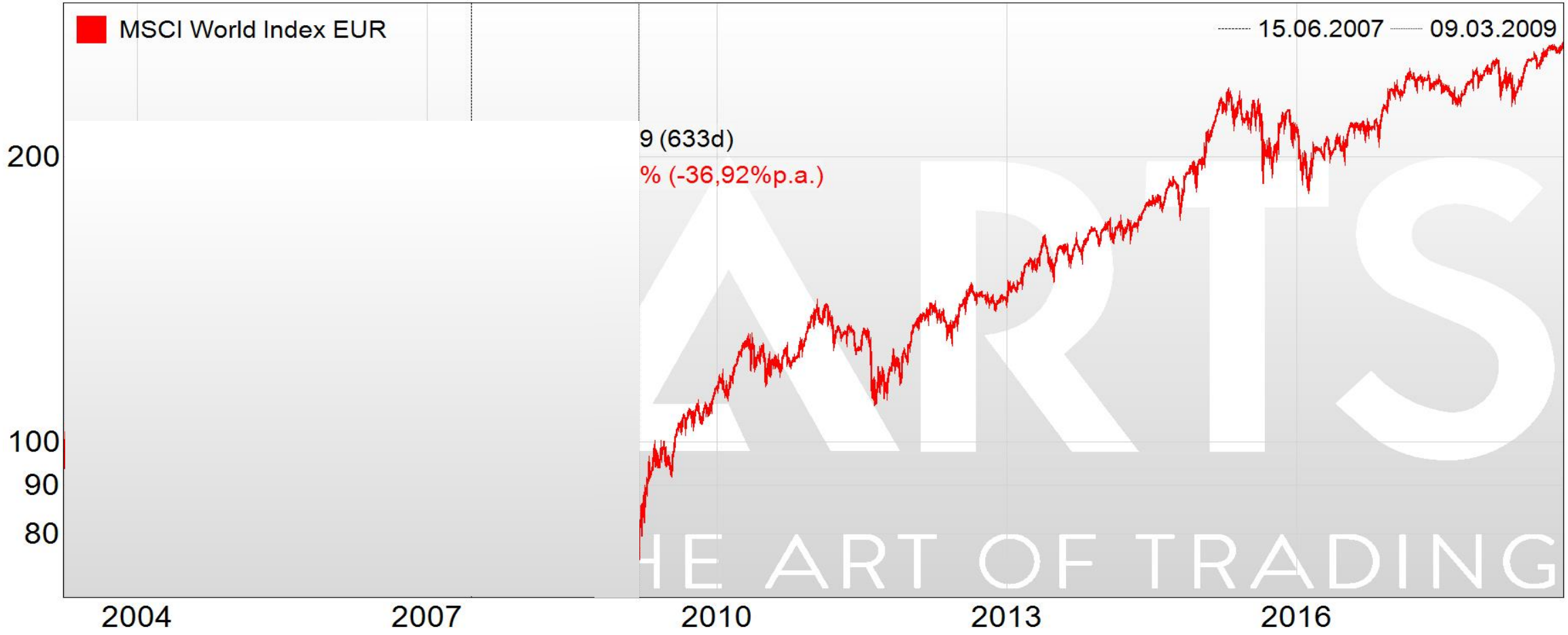
verschwindet die Abwärtsphase

aus den 10-Jahres-Charts!

Quelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH, Zeitraum: 27.03.2003-30.09.2018, logarithmische Performancedarstellung, Performanceangaben in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

Weltaktienmarkt

seit 27.03.2003



Quelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH, Zeitraum: 27.03.2003-30.09.2018, logarithmische Performancedarstellung, Performanceangaben in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

Weltaktienmarkt

10 Jahre

In den nächsten Monaten

verschwindet die Abwärtsphase

aus den 10-Jahres-Charts!

DAS RISIKO verschwindet NICHT.

Quelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH, Zeitraum: 27.03.2003-30.09.2018, logarithmische Performancedarstellung, Performanceangaben in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

Weltaktienmarkt

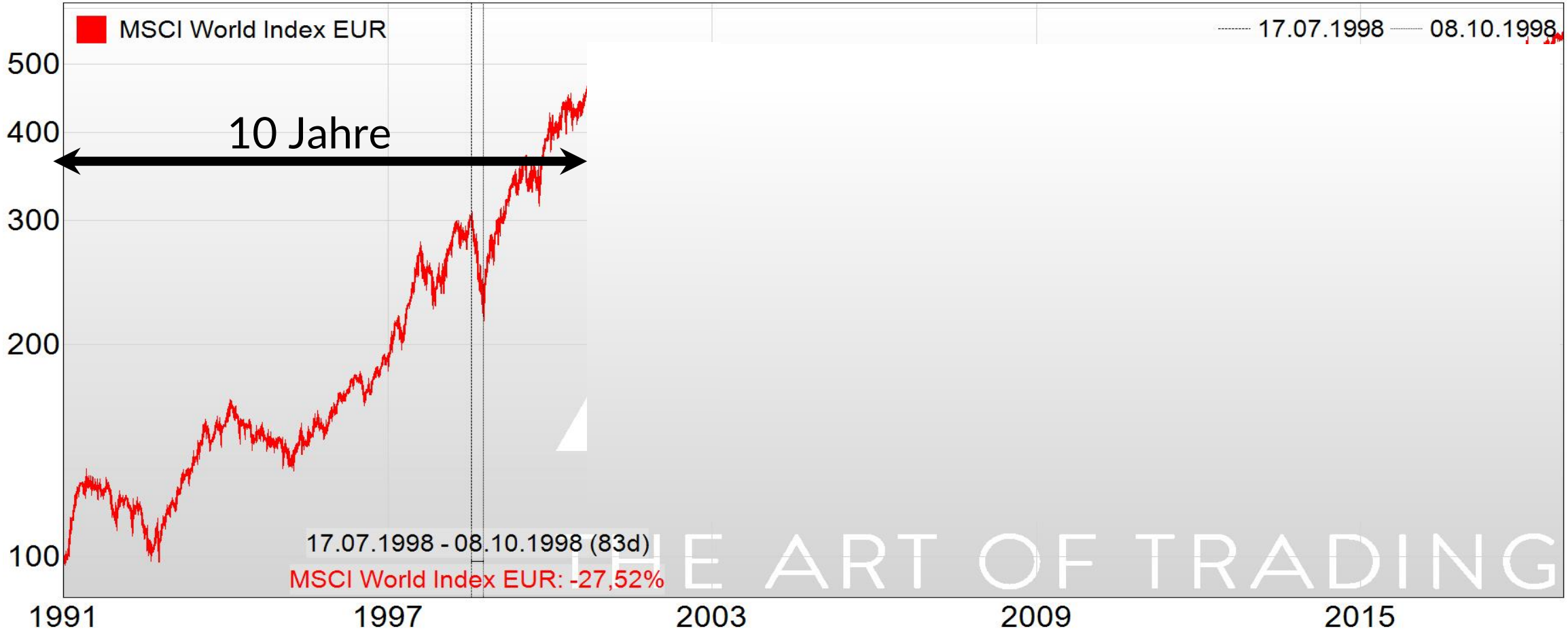
10 Jahre

scheinbar reduziert sich der maximale Verlust von –55 % auf –23 %

Quelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH, Zeitraum: 27.03.2003-30.09.2018, logarithmische Performancedarstellung, Performanceangaben in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

Weltaktienmarkt

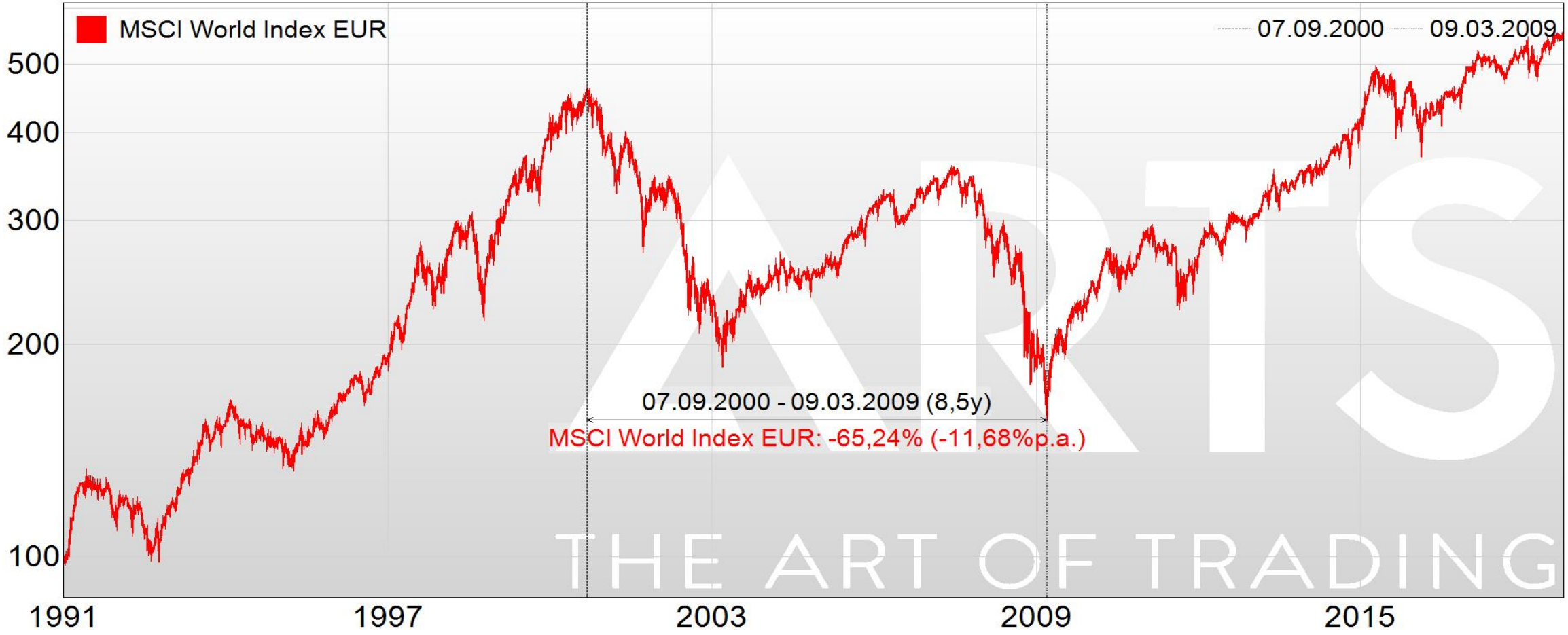
seit 1991



Quelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH, Zeitraum: Oktober 1990-30.09.2018, logarithmische Performancedarstellung, Performanceangaben in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

Weltaktienmarkt

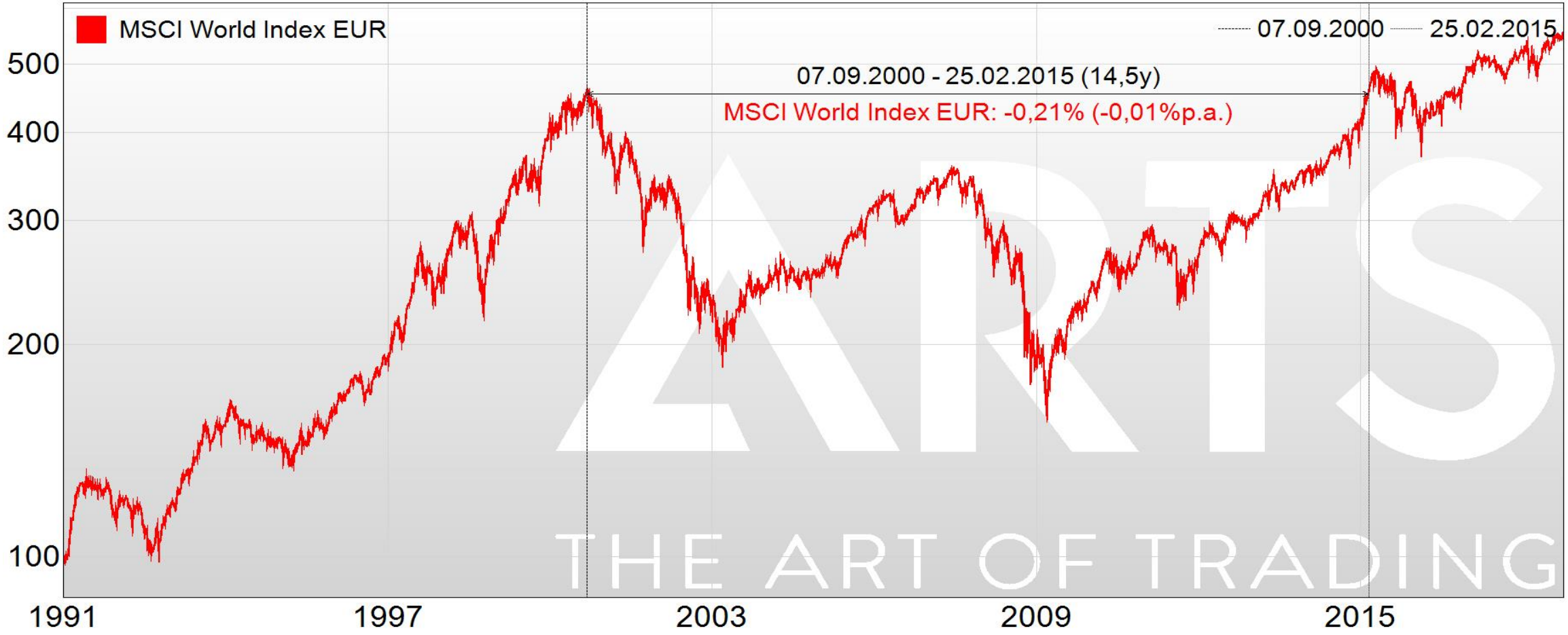
Maximaler Verlust



Quelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH, Zeitraum: Oktober 1990-30.09.2018, logarithmische Performancedarstellung, Performanceangaben in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

Weltaktienmarkt

Maximale Eholungsphase



Quelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH, Zeitraum: Oktober 1990-30.09.2018, logarithmische Performancedarstellung, Performanceangaben in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

Heimatmarkt Eurozone

seit 1987

Quelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH, Zeitraum: 01.01.1987-30.09.2018, logarithmische Performancedarstellung, Performanceangaben in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

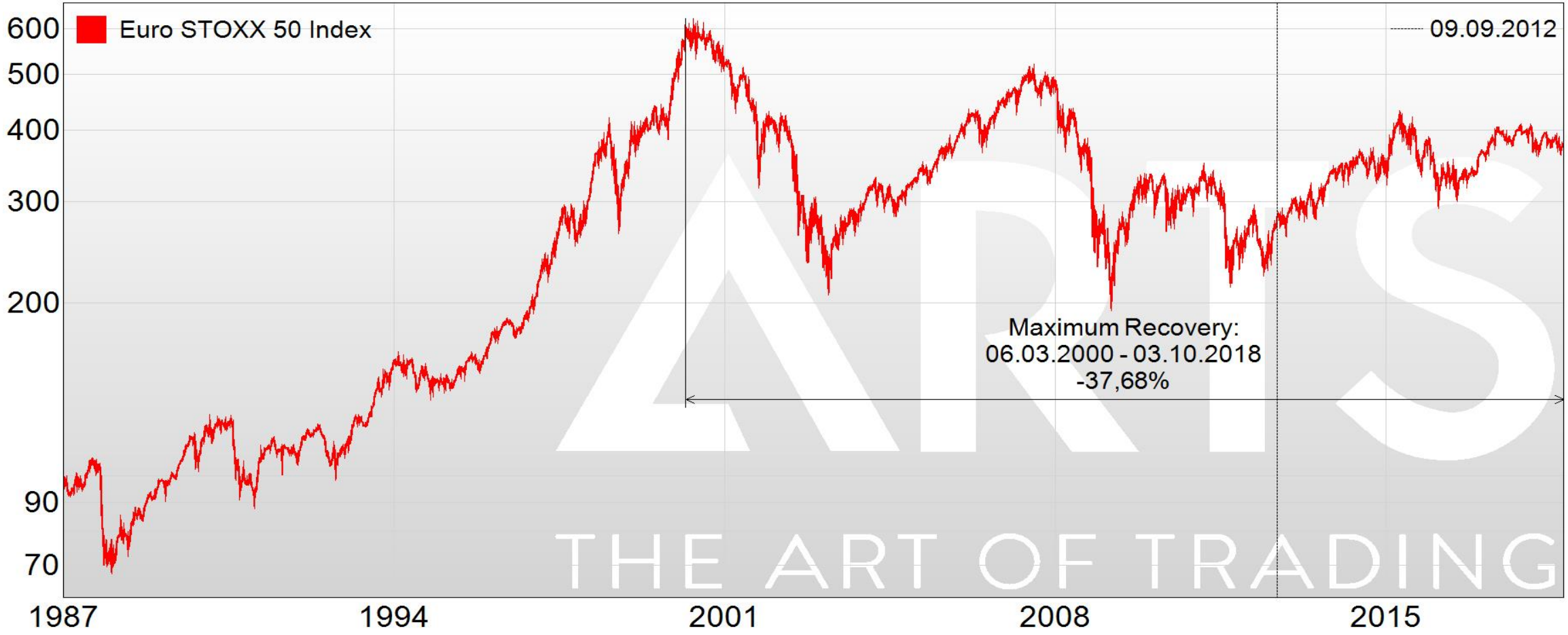
Heimatmarkt Eurozone

seit 1987 – maximaler Verlust

Quelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH, Zeitraum: 01.01.1987-30.09.2018, logarithmische Performancedarstellung, Performanceangaben in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

Heimatmarkt Eurozone

seit 1987 – maximale Erholungsphase



Quelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH, Zeitraum: 01.01.1987-30.09.2018, logarithmische Performancedarstellung, Performanceangaben in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

Heimatmarkt Eurozone

seit 1987

Seit März ist die Erholungsphase in Europa volljährig

und steht bei -37,68 %!

Noch +60,05 % notwendig…

Quelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH, Zeitraum: 01.01.1987-30.09.2018, logarithmische Performancedarstellung, Performanceangaben in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

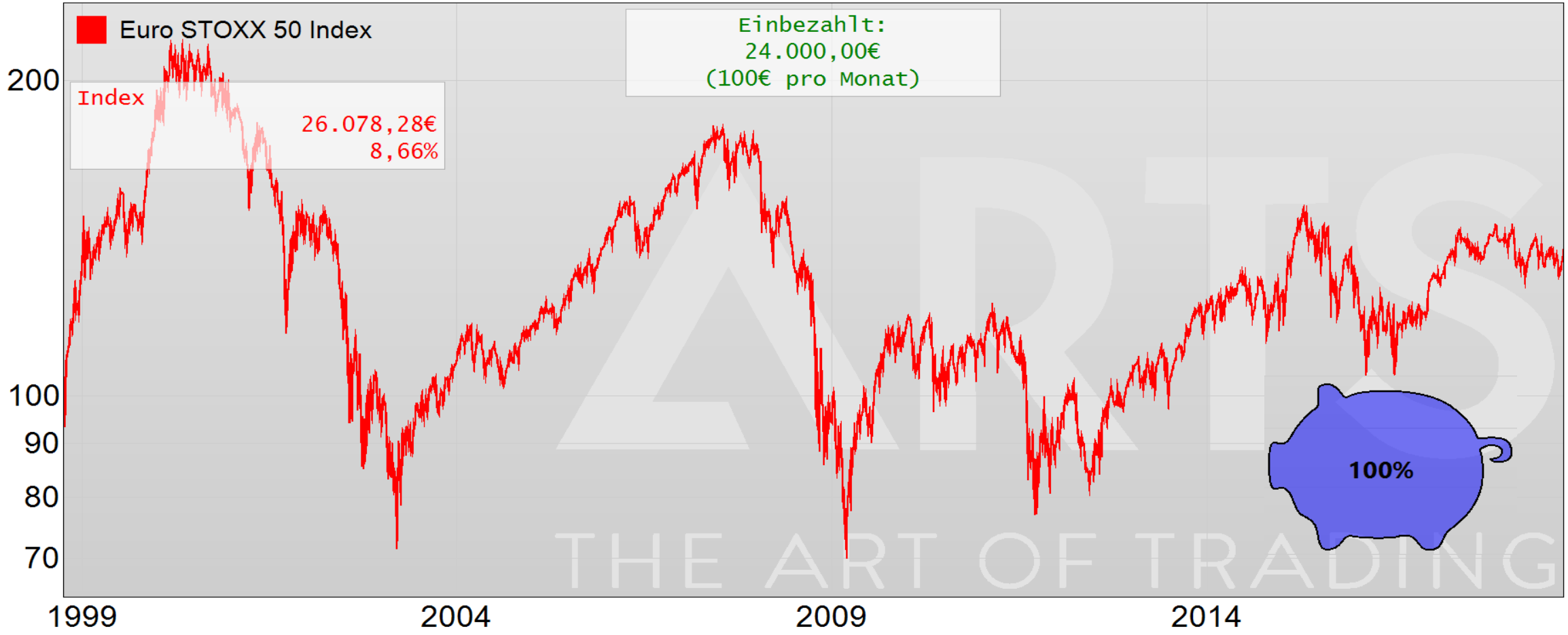
Heimatmarkt Eurozone

seit 1987

Quelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH, Zeitraum: 01.01.1987-30.09.2018, logarithmische Performancedarstellung, Performanceangaben in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

Heimatmarkt Eurozone

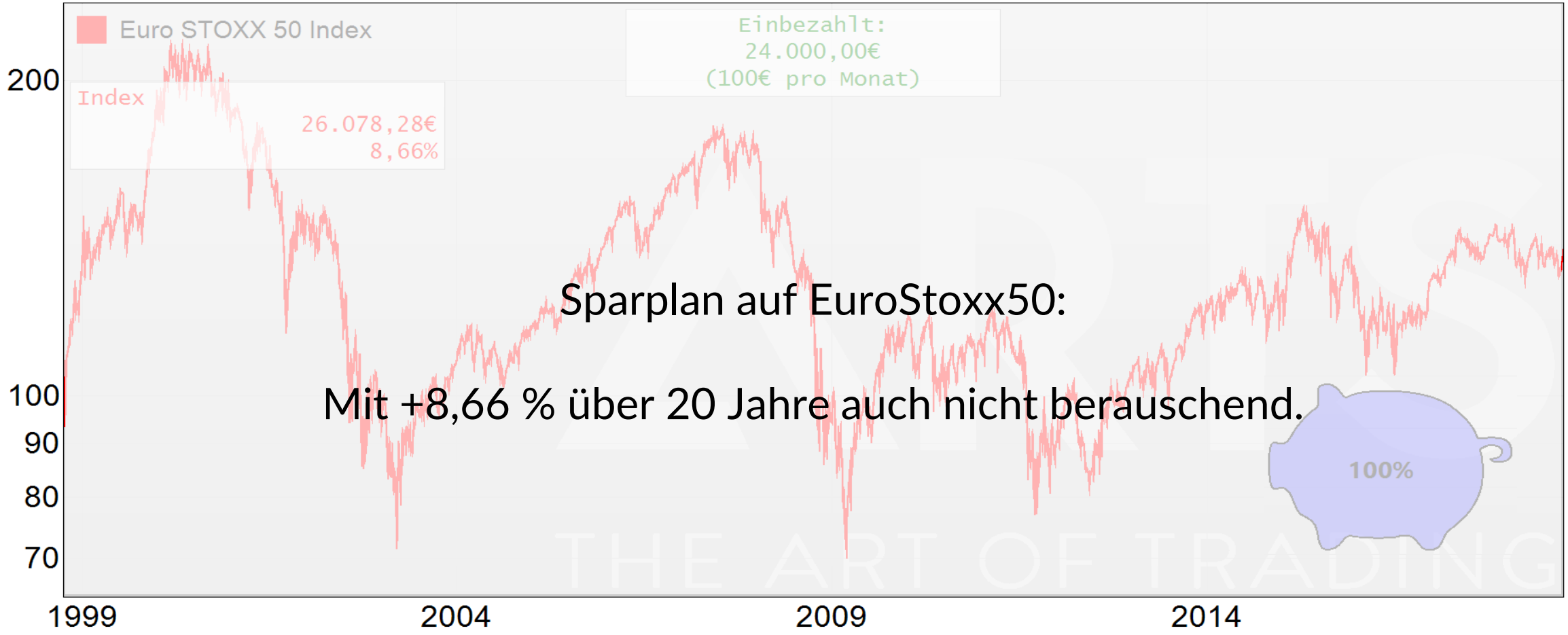
20 Jahre Sparplan



Quelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH, Zeitraum: 20.04.1998-30.09.2018, logarithmische Performancedarstellung, Performanceangaben in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

Heimatmarkt Eurozone

20 Jahre Sparplan



Sparplan auf EuroStoxx50:

Mit +8,66 % über 20 Jahre auch nicht berauschend.

Quelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH, Zeitraum: 20.04.1998-30.09.2018, logarithmische Performancedarstellung, Performanceangaben in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

ARTS
THE ART OF TRADING

FLEXIBILITÄT bleibt WICHTIG
Aber FLEXIBILITÄT in WELCHEM BEREICH?

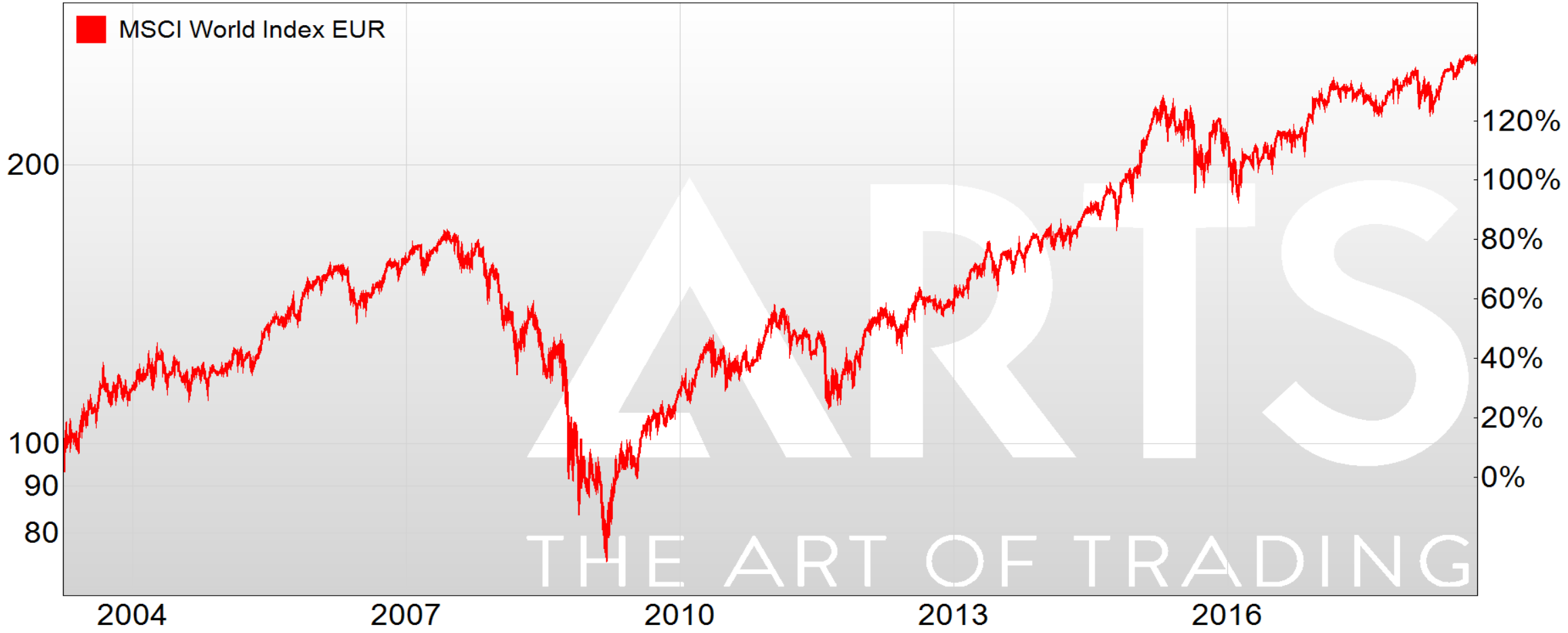
FLEXIBILITÄT bei AKTIEN

- FLEXIBILITÄT bei Höhe der Aktienquote

- FLEXIBILITÄT bei Regionen & Branchen innerhalb der Aktienquote

Weltaktienmarkt

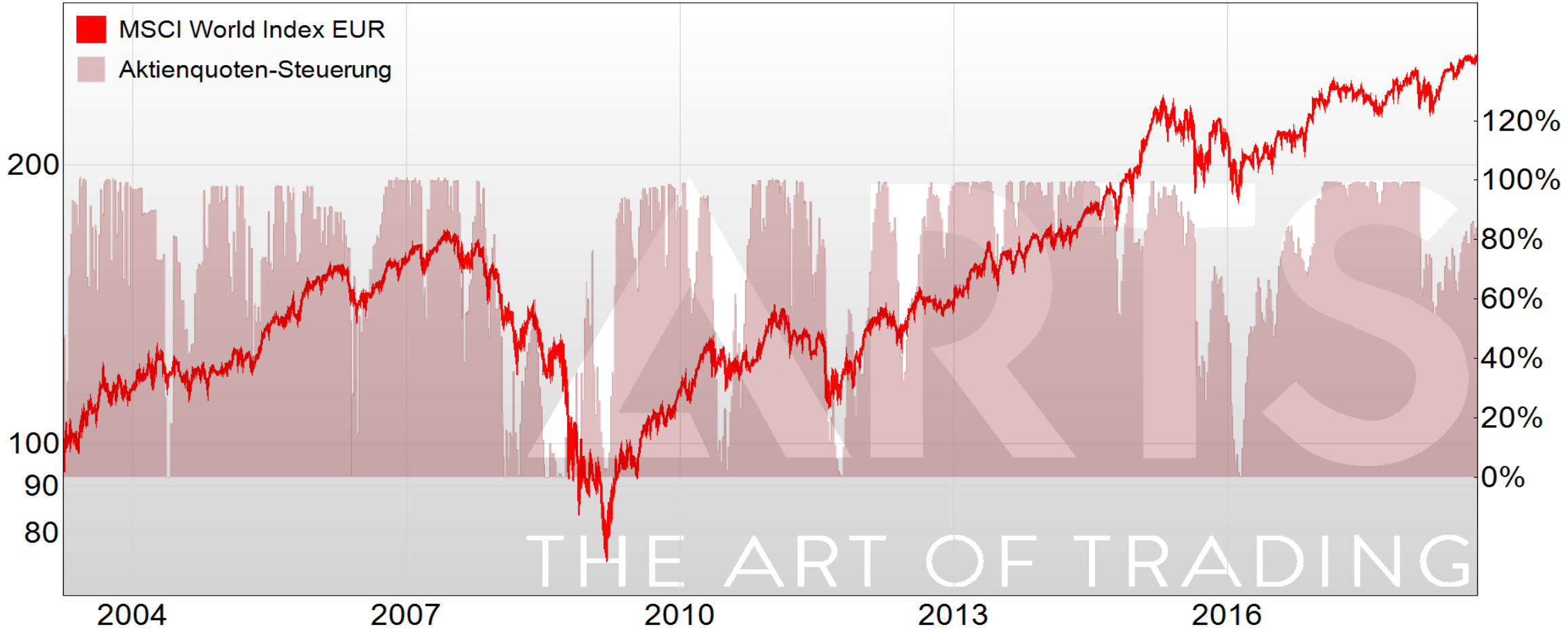
seit 27.03.2003



Quelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH, Zeitraum: 27.03.2003-30.09.2018, logarithmische Performancedarstellung, Performanceangaben in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

Aktienquoten-Steuerung

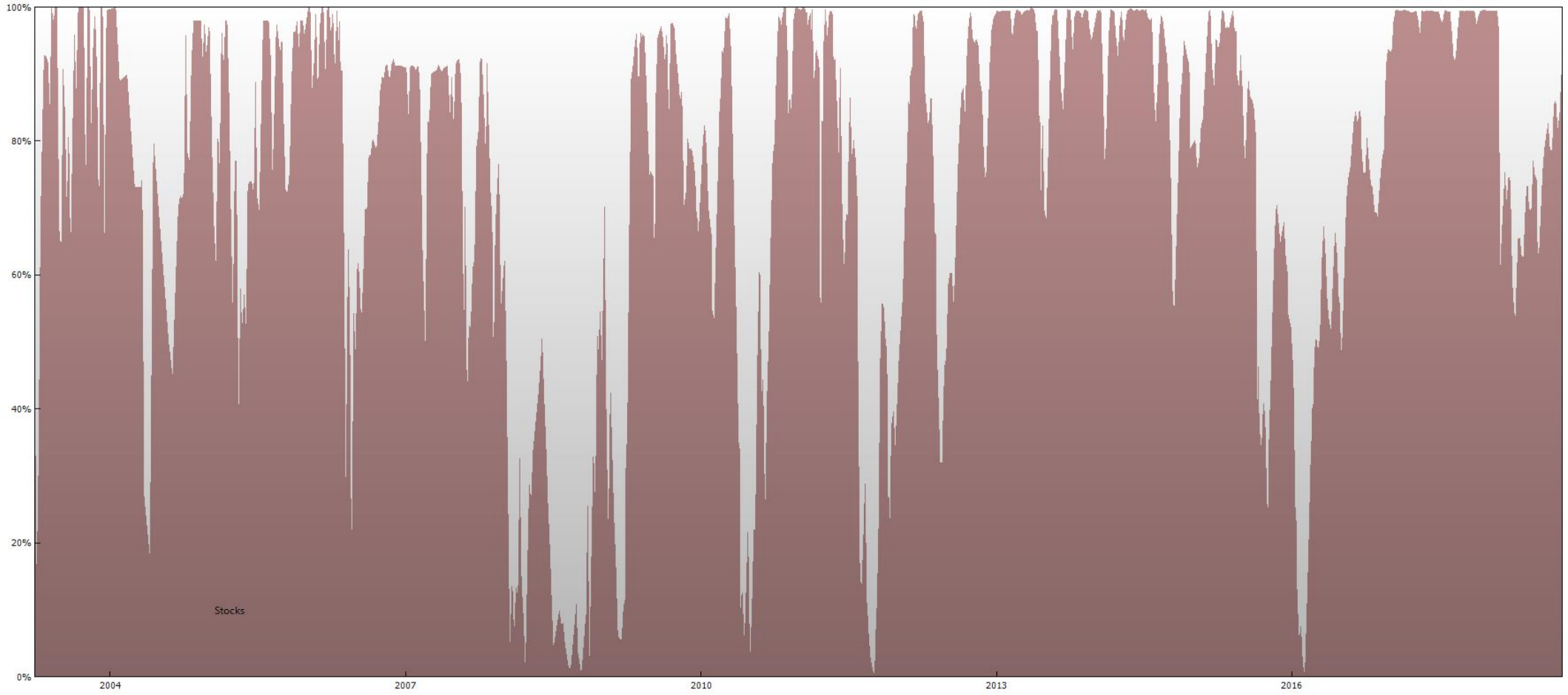
seit 27.03.2003



Quelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH, Zeitraum: 27.03.2003-30.09.2018, logarithmische Performancedarstellung, Performanceangaben in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

FLEXIBILITÄT bei der Höhe der Aktienquote

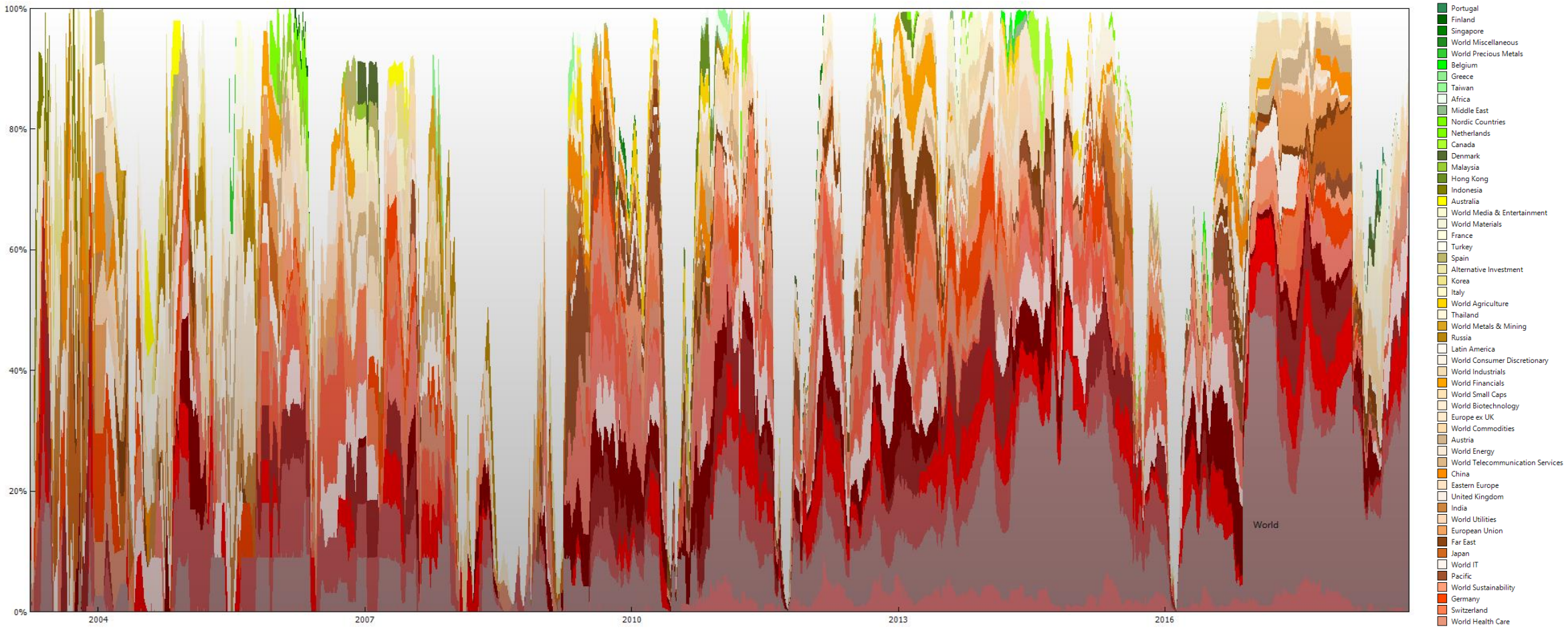
…am Beispiel C-QUADRAT ARTS Total Return Global AMI



Quelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH, Zeitraum: 27.03.2003-30.09.2018,.

FLEXIBILITÄT bei den Regionen und Branchen

…am Beispiel C-QUADRAT ARTS Total Return Global AMI

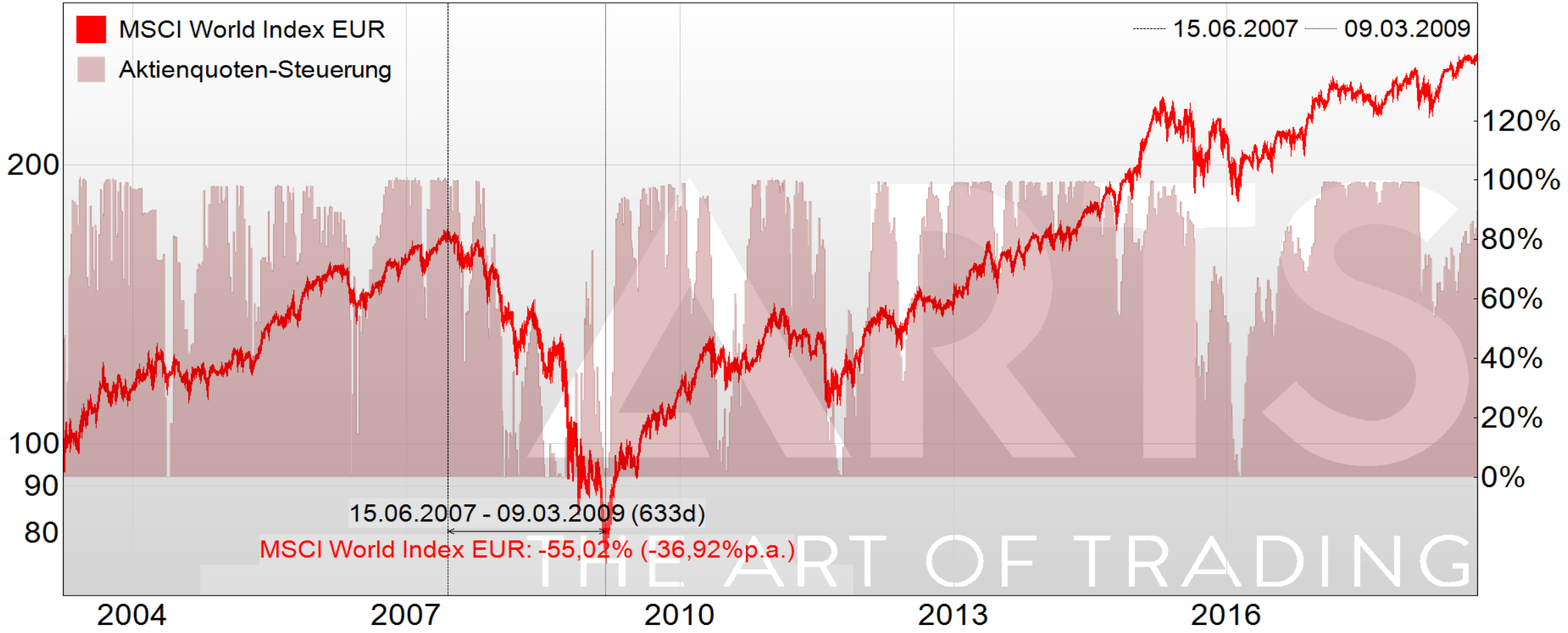


Quelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH, Zeitraum: 27.03.2003-30.09.2018,.

FLEXIBILITÄT im Aktienbereich – Ergebnisse

C-QUADRAT ARTS TR Global AMI vs. MSCI World

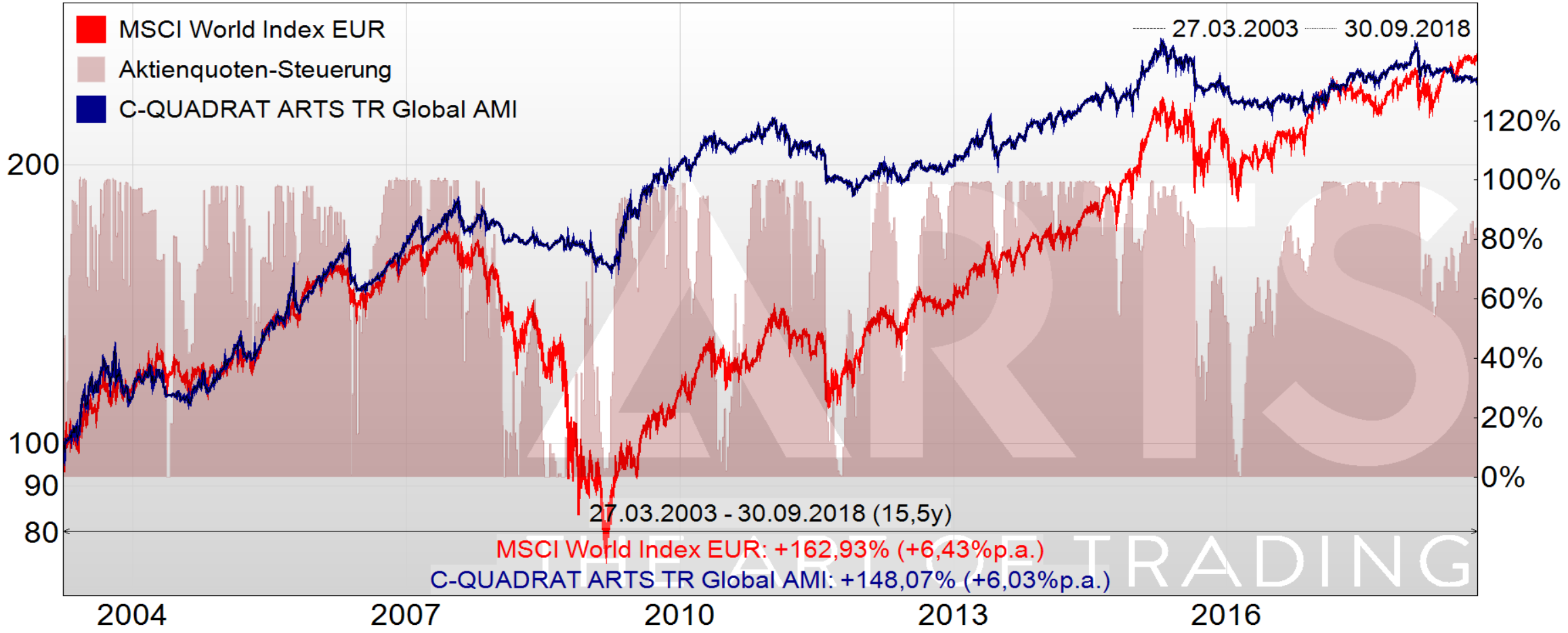
seit 27.03.2003



Quelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH, Zeitraum: 27.03.2003-30.09.2018, logarithmische Performancedarstellung, Performanceangaben in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Wertentwicklung. Der angeführte Aktienindex soll lediglich Rückschlüsse auf die entsprechende Marktentwicklung im jeweiligen Zeitraum geben.

C-QUADRAT ARTS TR Global AMI vs. MSCI World

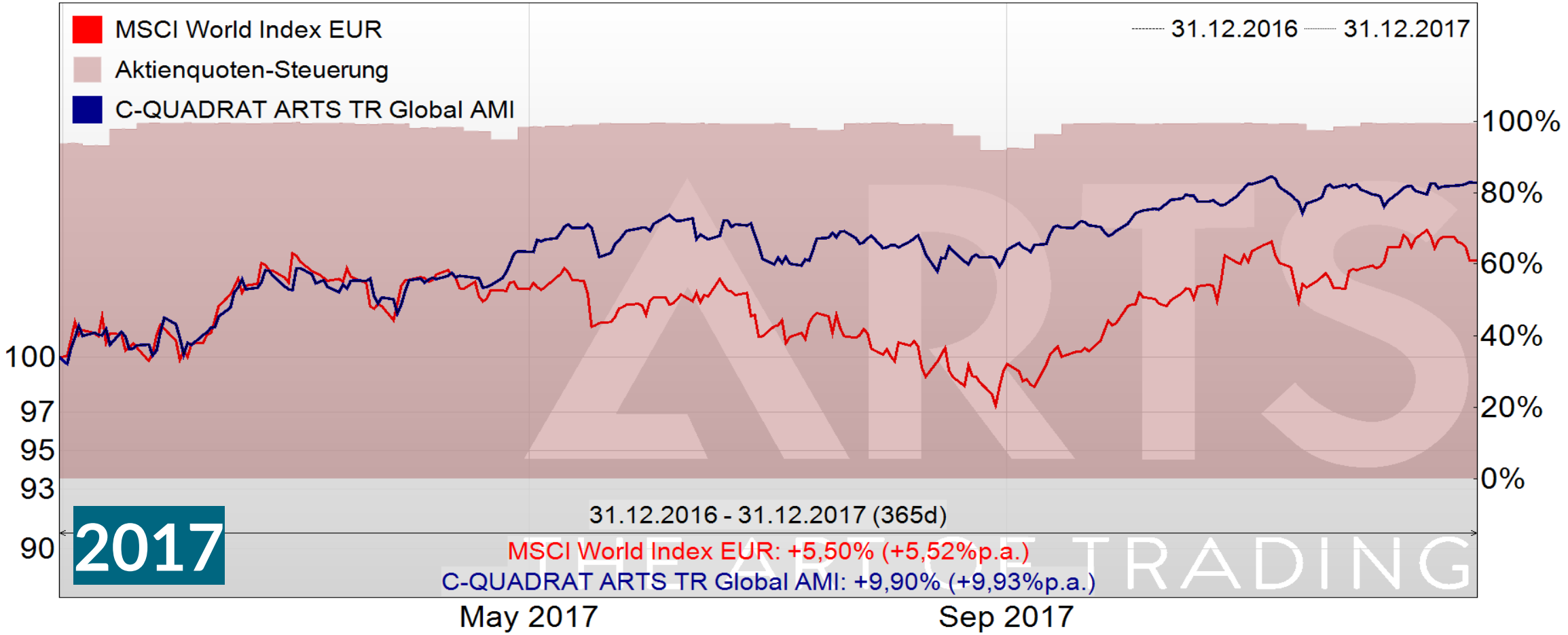
seit 27.03.2003



Quelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH, Zeitraum: 27.03.2003-30.09.2018, logarithmische Performancedarstellung, Performanceangaben in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Wertentwicklung. Der angeführte Aktienindex soll lediglich Rückschlüsse auf die entsprechende Marktentwicklung im jeweiligen Zeitraum geben.

C-QUADRAT ARTS TR Global AMI vs. MSCI World

2017



Quelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH, Zeitraum: 01.01.2017-31.12.2017, logarithmische Performancedarstellung, Performanceangaben in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Wertentwicklung. Der angeführte Aktienindex soll lediglich Rückschlüsse auf die entsprechende Marktentwicklung im jeweiligen Zeitraum geben.

ARTS
THE ART OF TRADING

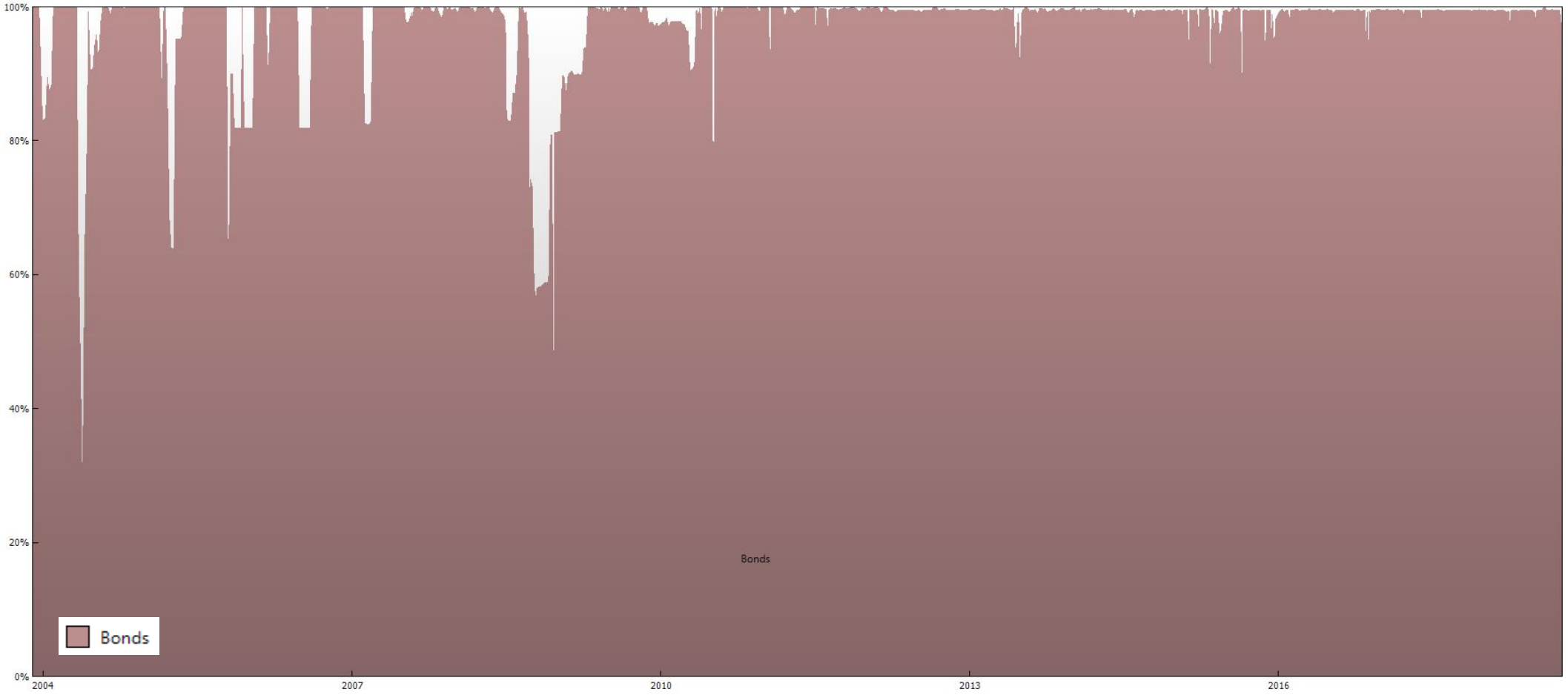
Aber reicht FLEXIBILITÄT im AKTIENBEREICH?

FLEXIBILITÄT bei ANLEIHEN

- FLEXIBILITÄT bei Höhe der Anleihenquote
- FLEXIBILITÄT bei Schuldnerklassen innerhalb der Anleihenquote
- FLEXIBILITÄT bei Regionen und Branchen innerhalb der Anleihenquote

FLEXIBILITÄT bei der Höhe der Anleihenquote

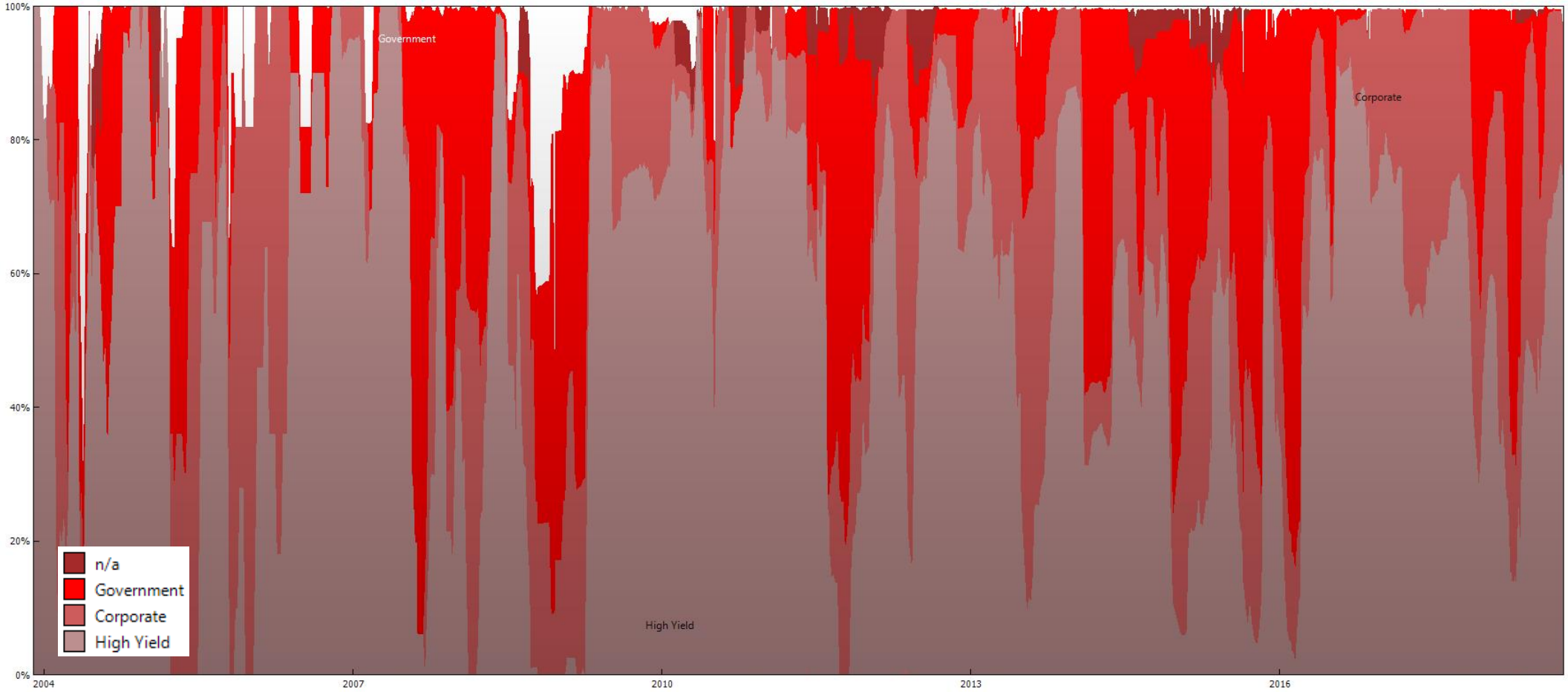
…am Beispiel C-QUADRAT ARTS Total Return Bond



Quelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH, Zeitraum: 24.11.2003-30.09.2018

FLEXIBILITÄT bei Schuldnerklassen

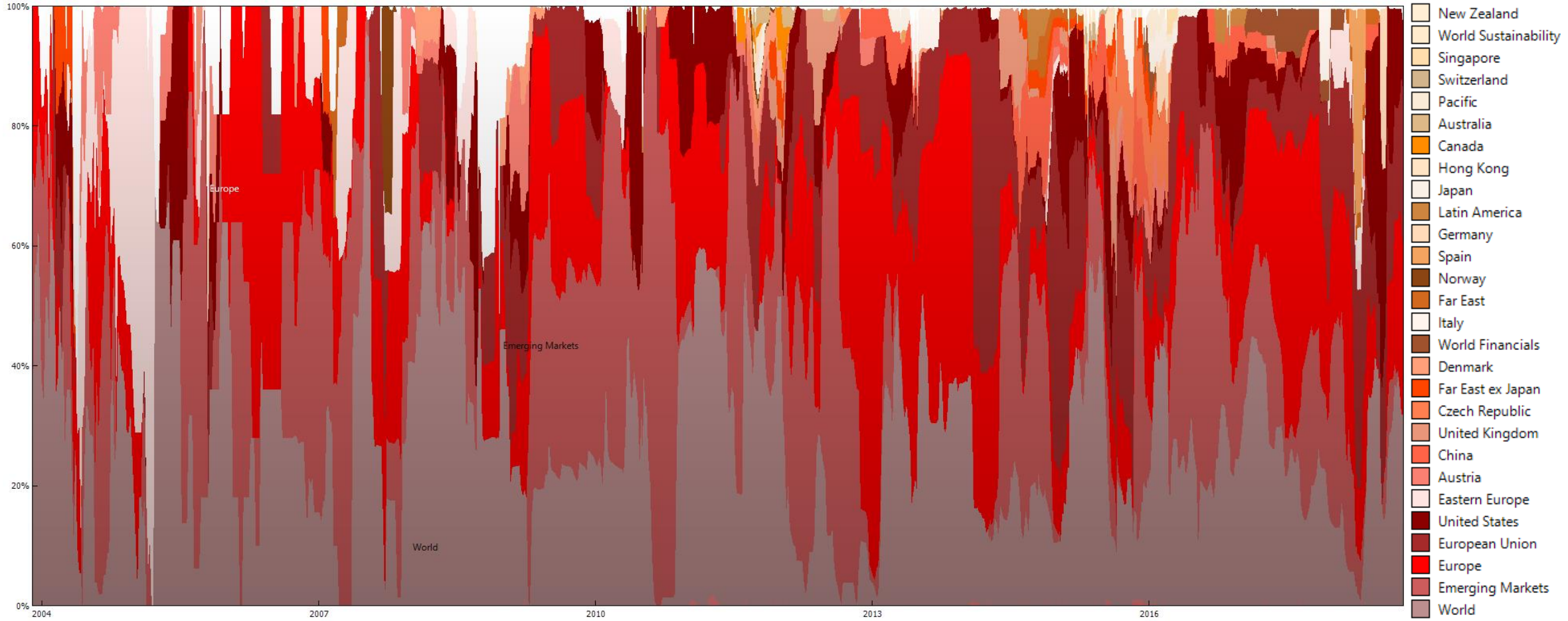
...am Beispiel C-QUADRAT ARTS Total Return Bond



Quelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH, Zeitraum: 24.11.2003-30.09.2018

FLEXIBILITÄT bei Regionen und Branchen

…am Beispiel C-QUADRAT ARTS Total Return Bond

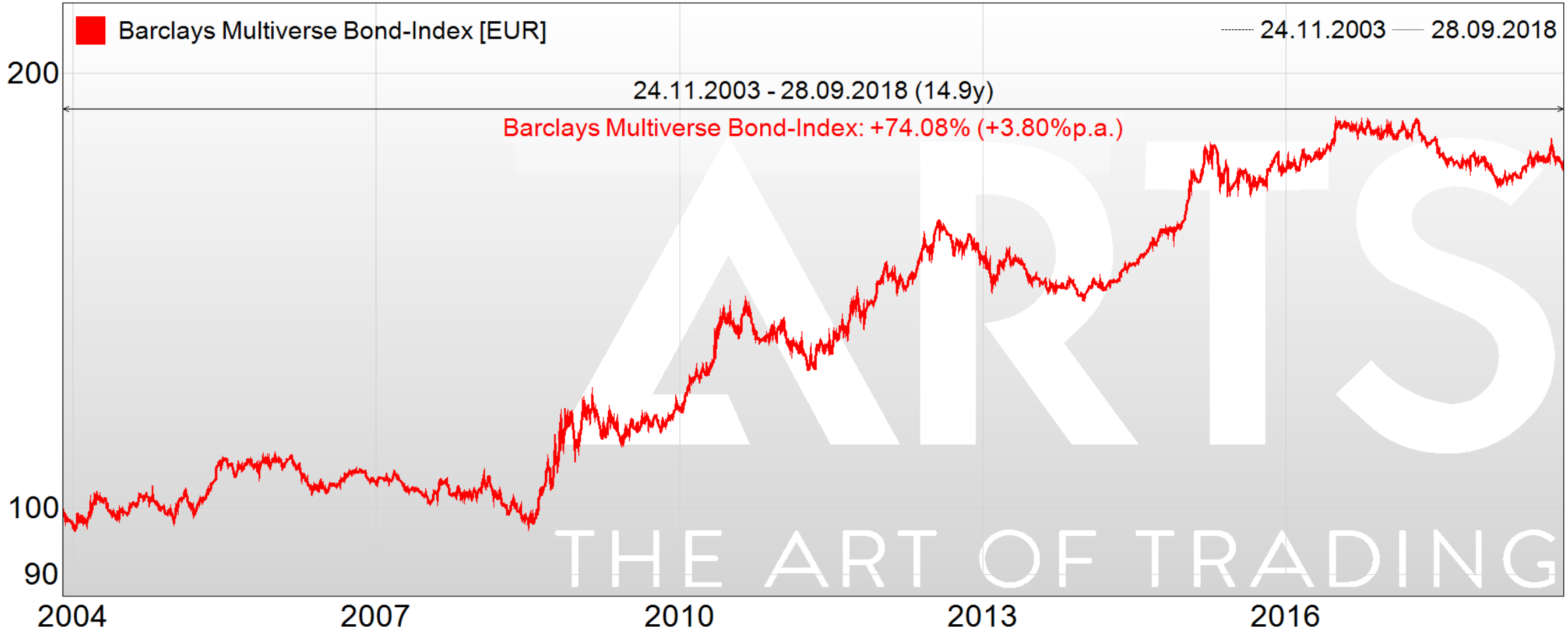


Quelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH, Zeitraum: 24.11.2003-30.09.2018

FLEXIBILITÄT im Anleihenbereich – Ergebnisse

C-QUADRAT ARTS TR Bond vs. globaler Bond-Index

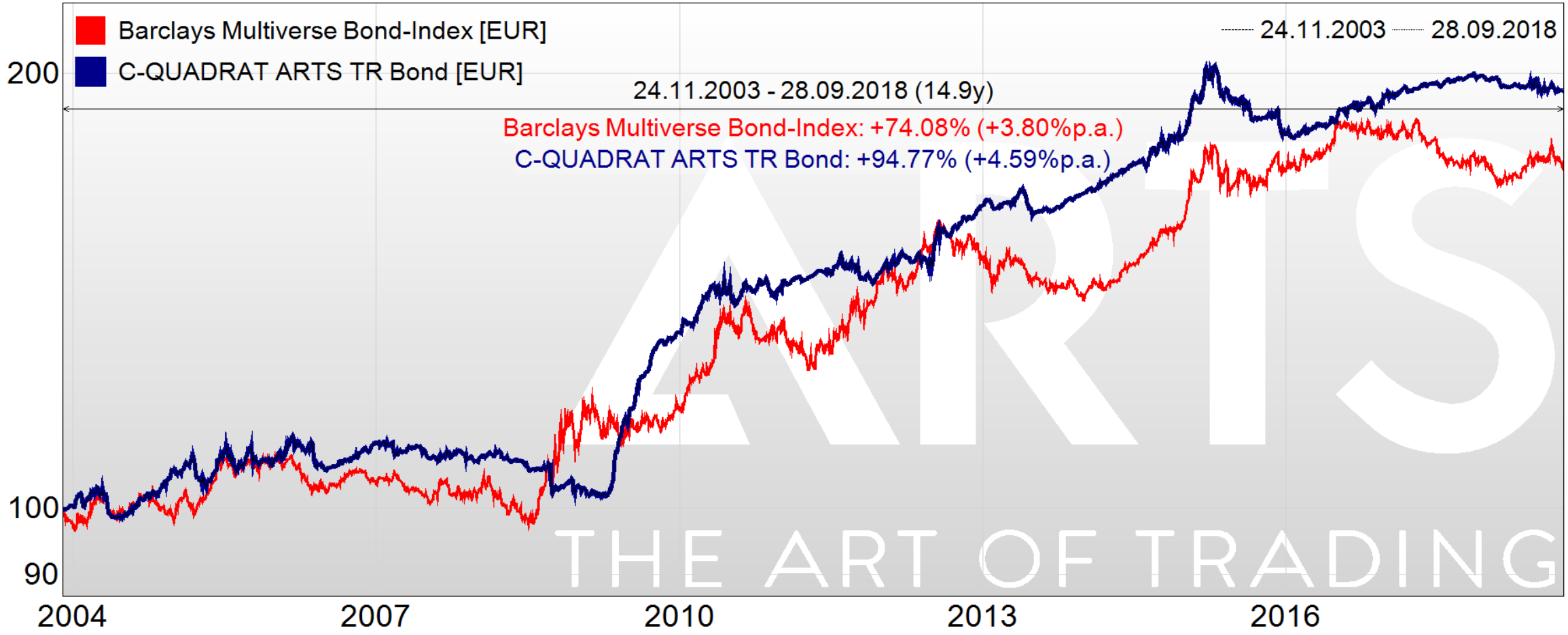
seit 24.11.2003



Quelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH, Zeitraum: 24.11.2003-30.09.2018, logarithmische Performancedarstellung, Performanceangaben in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Wertentwicklung. Der angeführte Aktienindex soll lediglich Rückschlüsse auf die entsprechende Marktentwicklung im jeweiligen Zeitraum geben.

C-QUADRAT ARTS TR Bond vs. globaler Bond-Index

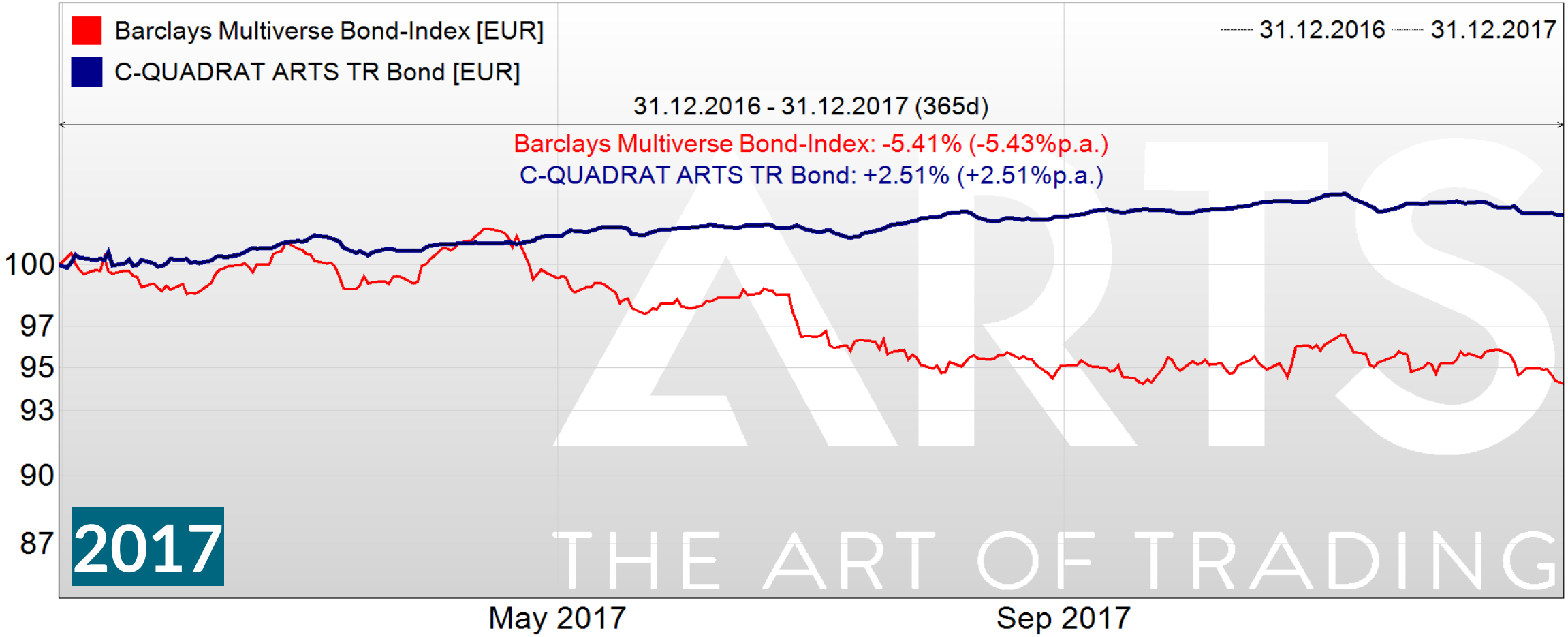
seit 24.11.2003



Quelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH, Zeitraum: 24.11.2003-30.09.2018, logarithmische Performancedarstellung, Performanceangaben in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Wertentwicklung. Der angeführte Aktienindex soll lediglich Rückschlüsse auf die entsprechende Marktentwicklung im jeweiligen Zeitraum geben.

C-QUADRAT ARTS TR Bond vs. globaler Bond-Index

2017



Quelle: Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH, Zeitraum: 01.01.2017-31.12.2017, logarithmische Performancedarstellung, Performanceangaben in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Wertentwicklung. Der angeführte Aktienindex soll lediglich Rückschlüsse auf die entsprechende Marktentwicklung im jeweiligen Zeitraum geben.

ARTS

THE ART OF TRADING

Gunther Pahl

g.pahl@c-quadrat.com

Wichtige Hinweise

Diese Präsentation dient ausschließlich Informationszwecken und stellt weder eine Marketingmitteilung, ein öffentliches Angebot, eine Empfehlung oder eine Aufforderung zum Kauf oder Verkauf von Fondsanteilen dar, noch ist sie als Aufforderung anzusehen, ein Angebot zum Abschluss eines Vertrages über eine Wertpapierdienstleistung oder Nebenleistung abzugeben. Alle Angaben und Inhalte dieser Präsentation sind ohne Gewähr, vertraulich und ausschließlich für den internen Gebrauch bestimmt.

Jede unautorisierte Form des Gebrauches dieses Dokumentes, insbesondere dessen Reproduktion, Verarbeitung, Weiterleitung oder Veröffentlichung ist untersagt. Der Ersteller dieses Dokumentes sowie mit ihm verbundene Unternehmen schließen jede Haftung für die Richtigkeit, Vollständigkeit oder Aktualität der enthaltenen Informationen und geäußerten Meinungen zur Gänze aus.
In diesem Dokument gegebenenfalls enthaltene Performancekennzahlen der Vergangenheit, Backtestdaten sowie vergangenheits- oder zukunftsbezogene Simulationen lassen keine Rückschlüsse auf die zukünftige Entwicklung dieser Zahlen oder der diesen zu Grunde liegenden Finanzinstrumente bzw. Indices zu und sind somit keine Gewähr für zukünftige Entwicklungen. Das gilt insbesondere für den Einsatz von Backtestdaten, welche immer zu hypothetischen, vergangenheitsbezogenen Darstellungen führen.

Jede Veranlagung ist mit einem Risiko verbunden. Kurse können sowohl steigen als auch fallen. Auch Währungsschwankungen können die Entwicklung eines Investments beeinflussen. Potentielle Anleger müssen sich der mit dem jeweiligen Finanzinstrument verbundenen Anlagerisiken bewusst sein, einschließlich des Risikos, den investierten Betrag vollständig zu verlieren. Ausgabe- und Rücknahmespesen sind in der Berechnung der Performanceergebnisse nicht berücksichtigt.

Grundlage für den Kauf von Investmentanteilen sind die jeweils gültigen Verkaufsprospekte, der Jahresbericht und, falls älter als acht Monate, der Halbjahresbericht. Die Wesentliche Information für den Anleger („KID", „KIID") und der veröffentlichte Verkaufsprospekt für die C-QUADRAT ARTS Fonds stehen dem Interessenten auf Deutsch oder Englisch am Sitz der Gesellschaft der C-QUADRAT Wealth Management GmbH, sowie online unter www.c-quadrat.com bzw. www.arts.co.at kostenlos zu Verfügung.

Die Darstellungen in diesem Dokument sind nur allgemeiner Natur, berücksichtigen nicht die individuelle steuerliche Situation des jeweiligen Anlegers und können sich jederzeit durch gesetzliche Änderungen oder Verwaltungspraxis verändern. Für detaillierte Auskünfte sollte daher ein Steuerberater kontaktiert werden. Folgende Datenquellen können verwendet werden: Bloomberg, Standard&Poor´s (Micropal), Cyberfinancials Datenkommunikation GmbH, ARTS Asset Management GmbH, Tipas, Profit Web, FAIT/Software Systems, OnVista, OeKB.

Copyright: ARTS Asset Management GmbH