

Anlagestrategie

Anlagepolitik

Die Anlagestrategie des Sentinel ist ein ein voll-automatisch von der 1000FTAD Software gehandeltes Handelskonto, welches gezielt breit gestreut in die verschiedensten Währungspaare investiert. Basierend auf einem double GRID and smooth submartingale Handelsansatz, der gegenseitig systematisch gehedged wird, ist eine hohe Renditeerwartung bei überschaubarem Risiko höchste Priorität. Die Auswahl der Währungspaare erfolgt nach dem qualitativen, die Umsetzung der Strategie nach dem quantitativen Ansatz. Unabhängig von der Marktentwicklung können sowohl in steigenden, als auch in fallenden Märkten Erträge erwirtschaftet werden. Ein für diese Assetklasse möglichst niedriges Risiko bei einer Rendite von 20-30% p.a. ist strategisches Ziel.

Die Anlagestrategie sieht vor, weltweit in wichtige Währungen im Rahmen von Managed Accounts zu investieren. Die Anlagestrategie kann ebenso mit 100% in einer einzelnen Asset-Klasse investiert sein, oder bis zu 100% des Vermögens in Cash halten.

Kommentar des Managements

Im März verzeichnete das Handelskonto ein moderates Minus, das in erster Linie auf ausgestoppte Hedging-Trades sowie den gezielten Abverkauf von Positionen mit hohen Swapkosten zurückzuführen ist. Trotz dieser Belastungen konnte der maximale Drawdown auf einem vergleichsweise niedrigen Niveau gehalten werden. Besonders betroffen zeigten sich die Währungspaare USDCHEF, USDCAD, EURAUD und GBP AUD, die unter erhöhter Volatilität und Positionsdruck standen. Hervorzuheben ist, dass in den Paaren USDCHEF und USDCAD noch immer Positionen aus dem August 2023 gehalten werden, deren negativer Swapkosten-Anteil das Monatsergebnis zusätzlich belastet hat. Die Handelssoftware reagierte jedoch flexibel und intelligent: Durch gezielte Positionsschließungen und eine strategische Reduzierung der Hedging-Komponenten konnte ein signifikanter Ausgleich erzielt und das Gesamtergebnis in vertretbaren Grenzen stabilisiert werden. Es ist in den kommenden Monaten weiterhin mit erhöhter Marktvolatilität zu rechnen. Die Software bleibt auf diese Entwicklungen vorbereitet und wird – wie bereits in der Vergangenheit – aktiv auf Marktveränderungen reagieren, um Kapital möglichst effizient zu schützen und Wachstum zu

Gewinner & Verlierer – Marktüberblick

Top Performer (ohne Währungen)

Baltic Dry +15,65% | Kupfer +11,51% | Silber +8,75% | Gold +10,80% | Palladium +9,83% | Platin +8,95% | AMEX Gold Bugs +6,93% | Natural Gas +6,87

Größte Verlierer (ohne Währungen)

Nasdaq 100 -6,47% | US2000 -5,74% | MSCI World -5,58% | Nikkei -4,12% | S&P500 -4,09%

Währungs-Gewinner

EURUSD +3,96% | EURJPY +3,63%
EURCAD +3,59% | EURAUD +3,12%
GBPUSD +2,67% | EURNZD +2,53%

Währungs-Verlierer

Litecoin -32,08% | Ethereum -16,53%
USDPLN -3,31% | USDHUF -3,22%
USDCHEF -2,03% | USDZAR -1,78%

Aktueller Wert

Wertentwicklung (in %)

<

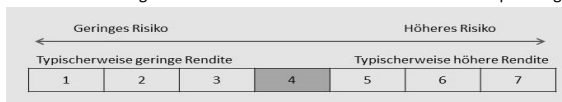
Kennzahlen

RISIKO Kennzahlen I (in %)	
max. mögl. Größe einer Einzelposition	5.00%
max. Wertverlust	-3.32%
max. Verlustdauer (Monate)	1
Recovery Period (Monate)	1
Sharpe Ratio (12-Monats-Basis)	7.63%
Sharpe Ratio (60-Monats-Basis)	k.A.
% positive Monate seit Handelsbeginn	86.67%
Maximaler Drawdown in %	5.34%
Volatilität (12-Monats-Basis)	9.61%
RISIKO Kennzahlen II (in %)	
Anzahl Positionen	224
Ø Größe des Devisen-Exposures	2.11%
Größtes Exposure	7.0783%
Kleinstes Exposure	0.0055%
Offene Positionen / Exposure	21.12%
Performance-Währung	EUR
STATISTIK Kennzahlen (in %)	
% profit trades	53.23%
% loss trades	46.77%
Largest profit trade	1.11%
Largest loss trade	-0.21%
Average profit trade	0.0085%
Average loss trade	-0.0073%

Allgemeine Daten

Verwaltung	1000FTAD AG													
Verwaltungsart	Devisenstrategie-Demo-Portfolio													
Risikoklasse der Anlagestrategie DD (SRRI) ^{1, 2}	◆	<table><tr><td>1</td><td>2</td><td>3</td><td>4</td><td>5</td><td>6</td><td>7</td></tr></table> Mittleres Risiko (4 von 7)						1	2	3	4	5	6	7
1	2	3	4	5	6	7								
Risikoklasse der Anlagestrategie Vola (SRRI) ^{1, 2}	■	<table><tr><td>1</td><td>2</td><td>3</td><td>4</td><td>5</td><td>6</td><td>7</td></tr></table> Mittleres Risiko (4 von 7)						1	2	3	4	5	6	7
1	2	3	4	5	6	7								
Risikoklasse der Anlageinstrumente (SRRI) ^{1, 2}		<table><tr><td>1</td><td>2</td><td>3</td><td>4</td><td>5</td><td>6</td><td>7</td></tr></table> Sehr hohes Risiko (7 von 7)						1	2	3	4	5	6	7
1	2	3	4	5	6	7								
annualisierte Jahresrendite ⁴	44.52%													
Anlagewährung	CHF													
Handelsstart der Software	06.12.2019													
Start der Allokation im Sentinel	01.01.2024													
Beteiligungsmöglichkeit	professionelle Anleger, Unternehmen, Family Offices Hedgefonds, Trusts, vermögende Privatinvestoren													
Art der Beteiligungsmöglichkeiten	Softwarelizenz, AIF, AMC Partizipationsscheine an 1000FTAD AG													
Tax Regime Partizipationsscheine für Länder	DBG Art. 20; StHG; VStG Schweiz													
Risikoklasse des Partizipationsscheines ³		<table><tr><td>1</td><td>2</td><td>3</td><td>4</td><td>5</td><td>6</td><td>7</td></tr></table> Mittleres bis hohes Risiko (5 von 7)						1	2	3	4	5	6	7
1	2	3	4	5	6	7								
Mindestanlagesumme ⁵	CHF 100.000													
Haltedauer	48 - 72 Monate													
Agio	0.00%													

¹ Synthetic Risk Reward Indicator (SRRI); Die Angaben des Risikoindikatoren wurden aufgrund des in den Handelskonten zugrunde liegenden maximalen Drawdowns und der zugrunde liegenden maximalen Volatilität errechnet. Die Angabe der Risikoklasse wird im nachstehenden Beispiel dargestellt:

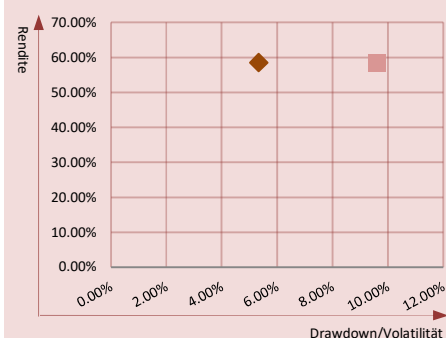


^{2,3} Risikoskala von 1 (geringstes Risiko) bis 7 (höchstes Risiko), wobei 1 nicht eine risikolose Investition bedeutet. Die Risikokategorie, in die diese Anlagestrategie/diese Partizipationsscheine fällt, ist nicht garantiert und kann sich im Laufe der Zeit ändern. DD = Drawdown, Vola = Volatilität.

⁴ Die annualisierte Jahresrendite ist eine Methode zur Berechnung der durchschnittlichen jährlichen Rendite einer Investition über einen bestimmten Zeitraum, die die Wirkung von Zinseszinsen berücksichtigt. Sie zeigt, wie viel ein Investor jährlich im Durchschnitt verdienen würde, wenn die Erträge gleichmäßig über den Zeitraum verteilt wären.

⁵ Zur Verwaltung nutzt die 1000FTAD AG die gleichnamige vollautomatische Devisenhandelssoftware. Professionelle Anleger, Unternehmen, Stiftungen und vermögende Privatpersonen können die Software mit einem Mindestinvestment von USD/EUR/CHF 3-10 Mio. im Lizenzverfahren nutzen. Anleger können sich ab CHF 100.000 über Partizipationsscheine an der 1000FTAD AG beteiligen.

Risk Return Diagramm



Allgemeiner Hinweis / Disclaimer

In diesem Dokument enthaltenen Angaben, Aussagen und Prognosen, dienen nur zu illustrativen Zwecken und stellen keine Anlageberatung dar, noch sind sie ein Angebot oder eine Einladung zu einem Angebot. Sie geben lediglich eine zusammenfassende Kurzdarstellung wesentlicher Merkmale der in den hinterlegten Demokonten erzielten Handelsergebnisse. Die Performance- und Transaktionsdaten dienen daher lediglich der unverbindlichen Information. Sämtliche dargestellten Renditen, Kurse, Allokationen und sonstigen Informationen beziehen sich ausschließlich auf die Strategie der 1000FTAD Software inklusive der Gebühren aus Anlagen und vor offenen Positionen (Exposure), Kosten und Gebühren des Emittenten. Die Wertstellung gehaltener Beteiligungen erfolgt jeweils zum Ende eines Geschäftsjahres der jeweiligen Unternehmen. Von uns monatlich ausgewiesene Wertentwicklungen beruhen ausschließlich auf internen Mitteilungen oder Quartalsberichten unserer Beteiligungspartner oder der unterlegten Handelskonten. Daher können diese trotz größter Sorgfalt, als vorläufig ausgewiesene Wertentwicklungen, vom Jahresergebnis abweichen. Performance-Ergebnisse der Vergangenheit lassen keine Rückschlüsse auf die künftige Entwicklung zu. Die hier enthaltenen Informationen können eine auf die individuellen Verhältnisse des Anlegers abgestellte anleger- und objektorientierte Beratung nicht ersetzen. Die 1000FTAD AG bietet ausschließlich Beteiligungen für einen begrenzten Anlegerkreis im Rahmen von Private Placements an. Die vollständigen Angaben zur Anlagestrategie sind den Informationen zur Geschäftstätigkeit der 1000FTAD AG, ergänzt durch die Informationen über die unternehmerische Kapitalanlage in Form von Partizipationsscheinen in Verbindung mit dem Zeichnungsschein sowie der ausführlichen Darstellung der Chancen und Risiken zu entnehmen. Sie sind in gedruckter Form kostenlos bei der 1000FTAD AG, Im Visionshaus, Hauptstr. 29, 9436 Balgach, St. Gallen/Schweiz erhältlich.

Die tatsächliche Anlagepolitik kann darauf ausgerichtet sein, schwerpunktmäßig Vermögensgegenstände z.B. nur weniger Währungen zu erwerben. Diese Allokation auf wenige spezielle Anlagensektoren kann mit besonderen Chancen verbunden sein, denen jedoch auch entsprechende Risiken (z.B. Marktenge, höhere Schwankungsbreiten, etc.) gegenüberstehen. Die Kurs- oder Marktentwicklung von Finanzprodukten hängt insbesondere von der Entwicklung der Kapitalmärkte ab, die u.a. von der allgemeinen Lage der Weltwirtschaft sowie den wirtschaftlichen und politischen Rahmenbedingungen in den jeweiligen Ländern beeinflusst wird. Durch den Ausfall eines Emittenten oder Kontrahenten können Verluste entstehen. Die 1000FTAD AG verwendet nur einen Teil ihres verfügbaren Kapitals im Rahmen der Anlagestrategie. Der Wert der auf Fremdwährungen lautenden Vermögensgegenstände kann schwanken. SWAP-, Derivate-, Zertifikat- oder CFD-Geschäfte können je nach Einsatzzweck gegebenenfalls die Renditechancen schmälern bzw. das Verlustrisiko zumindest erhöhen. Durch eine Änderung der Anlagepolitik kann sich das mit der Anlagestrategie verbundene Risiko inhaltlich verändern. Die Anlagestrategie ist neben der gesamten Geschäftstätigkeit der 1000FTAD AG nur ein Teil einer möglichen Wertentwicklung und weist deshalb aufgrund der vom Asset Management verwendeten Techniken eine erhöhte Volatilität auf, d.h., die Anteilspreise können auch innerhalb kurzer Zeiträume stärkeren Schwankungen nach unten oder nach oben unterworfen sein. Die in diesem Dokument enthaltenen Informationen sind durch und für die 1000FTAD AG und/oder ihre Inhalteanbieter urheberrechtlich geschützt. Sie dürfen nicht vervielfältigt oder verbreitet werden. Weder die 1000FTAD AG noch deren Inhalteanbieter sind verantwortlich für etwaige Schäden oder Verluste, die aus der Verwendung dieser Informationen entstehen. Alle Meinungsäußerungen geben die aktuelle Einschätzung der 1000FTAD AG wieder, die ohne vorherige Ankündigung geändert werden kann. Soweit in diesem Dokument enthaltene Daten von Dritten stammen, übernimmt die 1000FTAD AG für die Richtigkeit, Vollständigkeit und Angemessenheit dieser Daten keinerlei Gewähr, auch wenn die 1000FTAD AG nur solche Daten verwendet, die sie als zuverlässig erachtet. Wertentwicklungen der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung. Grundsätzlich gilt: **DIE RENDITE UND DER WERT DER ANLAGE SIND SCHWANKUNGEN UNTERWORFEN. ES KANN KEINE ZUSICHERUNG GEBEN WERDEN, DASS DIE ZIELE DER ANLAGEPOLITIK TATSÄCHLICH ERREICHT WERDEN. BEI DER BETEILIGUNG IN FORM VON PARTIZIPATIONSSCHEINEN, KANN EIN TEIL- UND/ODER TOTALVERLUST NICHT AUSGESCHLOSSEN WERDEN.**

Dieses Dokument ist kein Verkaufsprospekt und stellt kein Angebot zum Kauf oder Verkauf von Partizipationsscheinen dar und darf keinesfalls als solches verstanden werden. Auch sind Inhaber von Partizipationsscheinen nicht direkt an den Kapitalmarktinstrumenten der 1000FTAD AG beteiligt. Andernfalls sind sämtliche veröffentlichten Daten bezüglich des Firmenvermögens der 1000FTAD AG als reine Information zu betrachten. Die in diesem Reporting dokumentierten Ausführungen können sich jederzeit ohne vorherige Ankündigung ändern. Die Ausführungen gehen von der Beurteilung der gegenwärtigen Rechts- und Steuerlage aus.