# Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsfonds (SBA)

Stand: 29.02.2024

## Marketinginformationen

## Fondsmanagerkommentar

**Wissenschaftliche Begleitung:**

Dr. Schallmo ist Ökonom, Unternehmensberater und Professor für Digitale Transformation und Entrepreneurship an der Hochschule Neu-Ulm, Mitglied in wissenschaftlichen Gesellschaften und Autor von zahlreichen Artikeln und Büchern zu aktuellen Themen rund um Innovation, Digitalisierung sowie Geschäftsmodelle. Er hat praktische Erfahrung in unterschiedlichen Industrien und zu verschiedenen strategischen Themen. In seiner beratenden und wissenschaftlichen Tätigkeit ist er auf innovative Unternehmen und deren Weiterentwicklung spezialisiert. Dabei legt er besondere Aufmerksamkeit auf Faktoren, die die Stabilität von Unternehmen beeinflussen.

**Anlagebeirat:**

Der Fonds verbindet die Anforderungen von Stiftungen neben auskömmlichen Ausschüttungen einen langfristigen Vermögenserhalt zu gewährleisten mit dem Thema Nachhaltigkeit. Um dies zu erreichen, setzt die W & S Portfoliomanagement GmbH auf einen wissenschaftlich basierten Selektionsprozess. Der Anlagebeirat fungiert als Impulsgeber und Überwachungsorgan für das Investmentvermögen. Zum Anlagebeirat gehören Schwester Josefine, die Generaloberin des Klosters Brandenburg, Privatbankier Christian Sperrer vom Bankhaus Sperrer aus Freising, Professor Daniel Schallmo, Dr. Jörg Munzig und Hochschulprofessor Thomas Schempf, der als strategischer Berater von Stiftungen und Ordensgemeinschaften die Bedürfnisse dieser Anleger kennt.

Prof. Dr. Daniel Schallmo

## Fondsportrait

Der Fonds Werte & Sicherheit - Stiftungsvermögen verfolgt das Ziel, einen soliden und konstanten Wertzuwachs für Ausschüttungen bei stark verminderter Volatilität im Vergleich zu den gängigen Indizes zu erreichen.

Im Rahmen des Investmentprozesses werden substanzstarke Firmen mit einem nachhaltigen Geschäftsmodell, das Umsatz- und Ergebnisresilienz in konjunkturellen Schwächephasen gewährleistet, identifiziert.

Verschiedene Faktoren dienen als Leistungsnachweise und induzieren auch in schwierigen Marktphasen eine stabile Entwicklung des Unternehmens.

## Fondsberaterportrait

Die **W & S Portfoliomanagement GmbH** wurde 2017 als Vermögensverwalter für institutionelle Kunden mit Sitz in Ulm gegründet und ist zugelassenes Wertpapierinstitut i.S.d. §2 Abs. 1 mit Lizenz zur Finanzportfolioverwaltung.

Die beiden Gründer, Professor Dr. Daniel Schallmo und der geschäftsführende Gesellschafter Heribert Danner, teilen die Überzeugung, aus der Verknüpfung von wissenschaftlicher Theorie und den neuesten Möglichkeiten der Digitalisierung wie quantitative Analyse, Big Data und Künstliche Intelligenz Mehrwerte in Form geringerer Kosten, weniger Risiken und höherer Renditen zu generieren.

## Risiko- und Ertragsprofil

‹ Geringeres Risiko — Höheres Risiko ›

1 2 **3** 4 5 6 7

‹ Potenziell geringerer Ertrag — Potenziell höherer Ertrag ›

**Hinweis**

Der Gesamtrisikoindikator hilft Ihnen, das mit diesem Produkt verbundene Risiko im Vergleich zu anderen Produkten einzuschätzen. Er zeigt, wie hoch die Wahrscheinlichkeit ist, dass Sie bei diesem Produkt Geld verlieren, weil sich die Märkte in einer bestimmten Weise entwickeln oder wir nicht in der Lage sind, Sie auszubezahlen. Wir haben dieses Produkt auf einer Skala von 1 bis 7 in die Risikoklasse 3 eingestuft, wobei 3 einer mittelniedrigen Risikoklasse entspricht. Das Risiko potenzieller Verluste aus der künftigen Wertenwicklung wird als mittelniedrig eingestuft. Bei ungünstigen Marktbedingungen ist es unwahrscheinlich, dass die Fähigkeit beeinträchtigt ist, Ihr Rückgabeverlangen auszuführen.

Weitere Informationen zu den Risiken finden Sie in dem Dokument: Wesentliche Anlegerinformationen

**Empfohlener Anlagehorizont**

5

**Empfehlung**

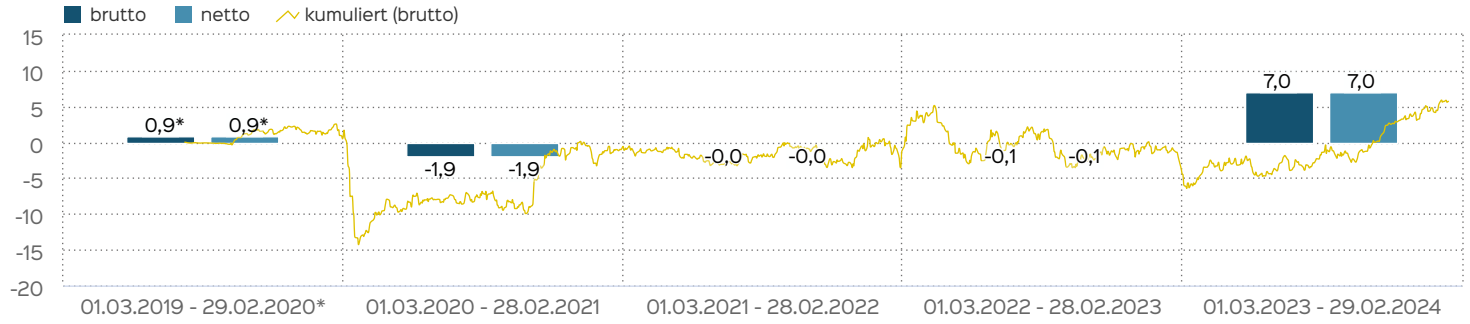
Der Risikoindikator beruht auf der Annahme, dass Sie das Produkt 5 Jahre halten. Wenn Sie die Anlage frühzeitig einlösen, kann das tatsächliche Risiko erheblich davon abweichen und Sie erhalten unter Umständen weniger zurück.

# Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsfonds (SBA)

Stand: 29.02.2024

W&S PORTFOLIO MANAGEMENT

## Wertentwicklung in 12-Monats-Perioden




Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung. Alle Wertentwicklungen gehen von einer Wiederanlage der Ausschüttungen und einem Anlagebetrag von 100.000 EUR aus und umfassen jeweils zwölf Monate. Die mit einem * gekennzeichneten Werte beziehen sich auf einen kürzeren Zeitraum (seit Auflegung). Nettowertentwicklung: Neben sämtlichen im Fonds anfallenden Kosten wird auch der jeweilige Ausgabeaufschlag berücksichtigt. Dieser wird zu Beginn des dargestellten Wertentwicklungszeitraumes vom Anlagebetrag abgezogen. Der Rücknahmeabschlag, sofern ein solcher erhoben wird, wird bei der Rückgabe der Fondsanteile abgezogen. Eine eventuell anfallende, die Wertentwicklung mindernde Depotgebühr bleibt außer Betracht. Bruttowertentwicklung: Entspricht der Nettowertentwicklung, berücksichtigt aber keinen Ausgabeaufschlag.

## Fondsprofil

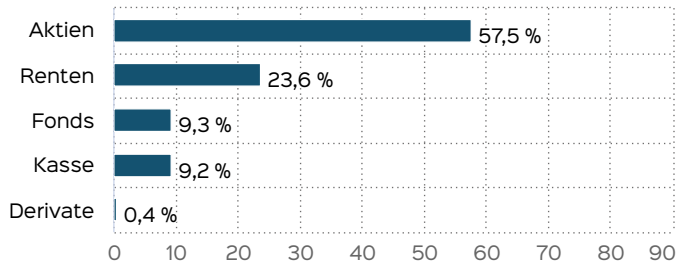
| | |
|---|---|
| Fondsname | Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsfonds |
| Anteilscheinklasse | (SBA) |
| ISIN | DE000A2PE1B6 |
| WKN | A2PE1B |
| Auflegungsdatum | 08.08.2019 |
| Gesamtfondsvermögen | 11,11 Mio. EUR |
| NAV | 97,81 EUR |
| Ausgabepreis | 97,81 EUR |
| Rücknahmepreis | 97,81 EUR |
| Fondswährung | EUR |
| Aktives Management | ja |
| Benchmark | 50% EuroStoxx 600, 50% 12M Euribor |
| Ausgabeaufschlag | 0,00 % |
| Rücknahmeabschlag | 0,00 % |
| Geschäftsjahresende | 30. Juni |
| Ertragsverwendung | Ausschüttung |
| TER (= Laufende Kosten) | 1,62 % |
| Verwaltungsvergütung | davon 1,22 % p.a. |
| Verwahrstellenvergütung | davon 0,04 % p.a. |
| Erfolgsabhängige Vergütung | Nein |
| VL-fähig | nein |
| Sparplanfähig | ja (mind 100.000,00 EUR) |
| Einzelanlagefähig | ja (mind 100.000,00 EUR) |
| Vertriebszulassung | DE |
| Cut-off time | 16:00 Uhr |

## Wertentwicklung in Perioden

| | kumuliert | p.a. |
|---|---|---|
| laufendes Jahr | 2,41 % | |
| 1 Monat | 0,74 % | |
| 3 Monate | 5,56 % | |
| 6 Monate | 9,43 % | |
| 1 Jahr | 6,99 % | 6,99 % |
| 3 Jahre | 6,81 % | 2,21 % |
| 5 Jahre | | |
| 10 Jahre | | |
| seit Auflegung | 5,71 % | 1,22 % |

Die frühere Wertentwicklung lässt nicht auf zukünftige Renditen schließen.

## Vermögensaufteilung

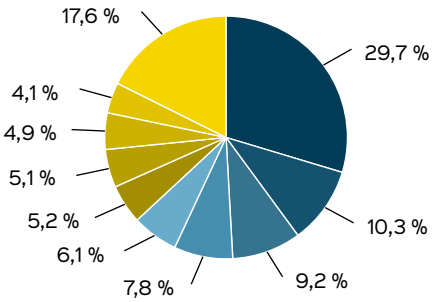


# Werte & Sicherheit - Nachhaltiger Stiftungsfonds (SBA)

Stand: 29.02.2024

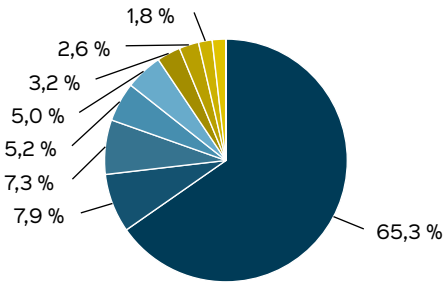
W&S PORTFOLIO MANAGEMENT

## Anlagestruktur nach Ländern



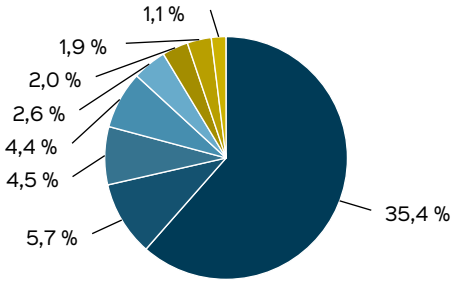

- Deutschland (29,7 %)
- Niederlande (10,3 %)
- Kasse (9,2 %)
- Schweiz (7,8 %)
- USA (6,1 %)
- Großbritannien (5,2 %)
- Finnland (5,1 %)
- Japan (4,9 %)
- Kanada (4,1 %)
- Sonstige (17,6 %)

## Anlagestruktur nach Währungen



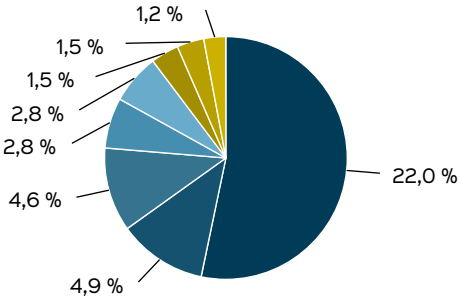

- Euro (65,3 %)
- Britisches Pfund (7,9 %)
- US-Dollar (7,3 %)
- Schweizer Franken (5,2 %)
- Japanischer Yen (5,0 %)
- Kanadischer Dollar (3,2 %)
- Australischer Dollar (2,6 %)
- Schwedische Krone (1,8 %)
- Norwegische Krone (1,8 %)
- Sonstige (0,0 %)

## Anlagestruktur nach Branchen




- Finanzdienstleister (35,4 %)
- Grundstoffe (5,7 %)
- Industrieunternehmen (4,5 %)
- Basiskonsumgüter (4,4 %)
- Gesundheitswesen (2,6 %)
- Technologie (2,0 %)
- Verbrauchsgüter (1,9 %)
- Versorgungsunternehmen (1,1 %)

## Anlagestruktur nach Indices

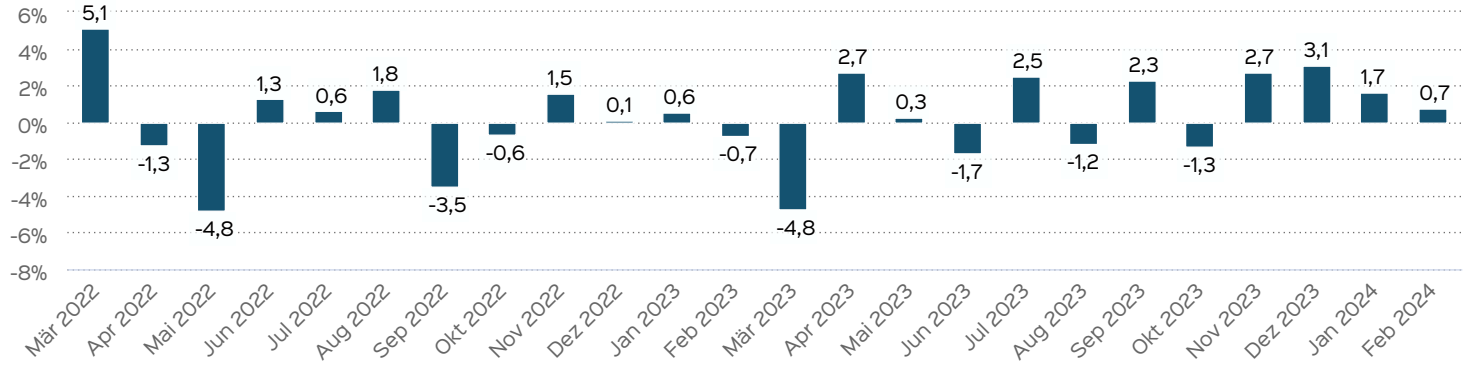



- STXE 600 Index (Price) (EUR) (22,0 %)
- Tokyo Stock Price (TOPIX) Index (4,9 %)
- sonstige Börsen (4,6 %)
- DAX Performance-Index (2,8 %)
- sonstige Europa (2,8 %)
- MDAX Index (1,5 %)
- sonstige USA (1,5 %)
- S&P 500 Index (1,2 %)

## Wertentwicklung auf Monatsbasis

Alle Angaben in Prozent

| Jahr | Jan | Feb | Mär | Apr | Mai | Jun | Jul | Aug | Sep | Okt | Nov | Dez | Wertentwicklung KJ |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 2022 | 2,49 | -0,66 | 5,15 | -1,26 | -4,83 | 1,26 | 0,65 | 1,82 | -3,48 | -0,65 | 1,55 | 0,15 | 1,82 |
| 2023 | 0,59 | -0,73 | -4,75 | 2,73 | 0,30 | -1,69 | 2,52 | -1,16 | 2,28 | -1,35 | 2,74 | 3,08 | 4,32 |
| 2024 | 1,65 | 0,74 | | | | | | | | | | | 2,41 |




Die frühere Wertentwicklung lässt nicht auf zukünftige Renditen schließen.

## Wichtige Hinweise

Quelle aller Daten, sofern nicht anders angegeben: HANSAINVEST.

Dies sind Marketinginformationen. Bitte lesen Sie den Verkaufsprospekt und das Basisinformationsblatt bevor Sie eine endgültige Anlageentscheidung treffen. Grundlage für den Kauf sind die jeweils gültigen Verkaufsunterlagen, die ausführliche Hinweise zu den einzelnen mit der Anlage verbundenen Risiken enthalten. Der Verkaufsprospekt und die wesentlichen Anlegerinformationen sind ausschließlich in deutscher Sprache in elektronischer Form erhältlich. Auf Wunsch senden wir Ihnen Druckstücke kostenlos zu.

Der Nettoinventarwert von Investmentfonds unterliegt in unterschiedlichem Maße Schwankungen und es gibt keine Garantie dafür, dass die Anlageziele erreicht werden. Es besteht die Gefahr, dass der Anleger durch den Erwerb der Anlage einen finanziellen Verlust erleidet. Mit dem Erwerb der beworbenen Anlage erwirbt der Anleger lediglich Anteile an einem Fonds und nicht die im Fonds enthaltenen Basiswerte, wie z.B. ein Gebäude oder die Aktie eines Unternehmens.
Die Wertentwicklung wird nach der BVI-Methode ermittelt. Informationen zur genauen Berechnungsweise der Wertentwicklungen erhalten Sie im Internet unter Rechenartenbeschreibung .
Die zukünftige Wertentwicklung unterliegt der Besteuerung. Diese ist von der persönlichen Situation des jeweiligen Anlegers abhängig und kann sich in der Zukunft ändern.
Das Gesamtfondsvermögen bezieht sich auf das Fondsvermögen aller zum Fonds zugehörigen Anteilsklassen. Dabei wird das Gesamtfondsvermögen in der Währung der Anteilsklasse ausgewiesen, die als erstes aufgelegt wurde.
Die angegebenen laufenden Kosten (Gesamtkostenquote) fielen im letzten Geschäftsjahr des Sondervermögens an; bei neu aufgelegten Fonds handelt es sich um eine Schätzung für das erste Geschäftsjahr. Die anfallenden Kosten können von Jahr zu Jahr schwanken und verringern die Ertragschancen des Anlegers. Nähere Informationen zu den Kosten und zu einer etwaigen Erfolgsvergütung und deren Zusammensetzung sind aus den wesentlichen Anlegerinformationen zu entnehmen.

Es wird keine Erfolgsvergütung berechnet.

Die in den gegebenenfalls dargestellten Anlagestrukturen oder Vermögensaufteilungen angegebenen Prozentwerte beziehen sich generell auf das gesamte Fondsvermögen. Für die Darstellung einzelner Strukturen wird jeweils nur eine Teilmenge der Vermögensarten als Basis verwendet (z.B. bei Branchen nur der Aktienanteil), so dass in der Summe nicht zwingend 100% erreicht werden.
Die Darstellung der Top Wertpapiere (sofern angezeigt) erfolgt für maximal 60% des Fondsvermögens.
Bei den dargestellten Werten handelt es sich um gerundete Werte, so dass die Summe der Werte von 100 % abweichen kann.
Die Cut-off time bezeichnet den täglichen Orderannahmeschluss der Verwahrstelle des Fonds. Sie wird bei der depotführenden Stelle des Anlegers regelmäßig früher liegen.
Dieses Dokument und die in ihm enthaltenen Informationen richten sich nicht an US-Personen und dürfen nicht in den USA verbreitet werden.
Eine Zusammenfassung der Anlegerrechte in deutscher Sprache können Sie auf unserer Website unter Compliance erhalten.
Der Vertrieb des Fonds kann jederzeit in Übereinstimmung mit den Vorschriften des KAGB widerrufen werden.

## Kennzahlen

| | |
|---|---|
| Bestimmtheitsmaß | 0,06 |
| Alpha | -11,04 % |
| Beta | 0,13 |
| Korrelation | 0,14 |
| Information Ratio | -18,96 |
| Dauer des Verlustes in Tagen | 663 |
| Sharpe Ratio | 0,14 |
| Volatilität | 6,57 % |
| Max Drawdown | -11,01 % |
| Anzahl negativer Monate | 15 |
| Anzahl positiver Monate | 21 |
| Anteil positiver Monate | 58,33 % |
| Schlechtester Monat | -4,83 % |
| Bester Monat | 5,15 % |

## Rentenkennzahlen

| | |
|---|---|
| Durchschnittsrating | BBB- |
| Yield to Maturity | 4,4 % |
| Zinssatz | 4,52 % |
| Rendite | 4,59 % |
| durchschnittliche Restlaufzeit | 4,7 |
| Mod. Duration | 6,38 |
| Duration | 6,65 |

## Kontakt: Fondsmanager

W & S Portfoliomanagement GmbH
Karlstraße 37
89073 Ulm
Tel: +49 (0)731 38 90 10-22
E-Mail: info@werteundsicherheit.de
Internet: http://www.werteundsicherheit.com

## Verwaltungsgesellschaft

**Weltoffen. Partnerschaftlich. Verlässlich.**
**An diesen Werten wollen wir uns messen lassen.**

Als eines der ältesten Investment-Unternehmen in Deutschland prägen traditionelle hanseatische Prinzipien, wie Weltoffenheit, Vertrauenswürdigkeit und Verlässlichkeit, seit jeher unsere Firmenphilosophie. Innovatives Denken und eine konsequente Serviceorientierung haben uns zu dem gemacht, was wir heute sind: Eine Kapitalverwaltungsgesellschaft, deren oberstes Ziel es ist, für ihre Kunden Werte zu schaffen.

HANSAINVEST ist eine Tochter der SIGNAL IDUNA Gruppe.

**Kontakt:**

HANSAINVEST
Hanseatische Investment-GmbH
Kapstadtring 8
22297 Hamburg
Telefon: (0 40) 3 00 57 - 0
Telefax: (0 40) 3 00 57 - 60 70
E-Mail: service@hansainvest.de
Internet: https://www.hansainvest.com