

Vermögensverwaltung: Modern

(ab 500'000.-)

Long/Short

Das gleichzeitige halten von Long- und Short-Positionen kann bei richtiger Anwendung den Sharpe Ratio¹ Ihres Portfolios reduzieren.

Es erlaubt zudem den Anteil des Dividendeneinkommens, welchen man bei hohen Bargeldbeständen u.U. nicht hat, zu sichern. Gleichzeitig wird das Risiko gegenüber den Aktienkursfluktuationen (Volatilität) reduziert.

Diese Liste ist nicht abschliessend: Kontaktieren Sie uns, falls Sie mehr über diese Anlagestrategien und die konkrete Ausgestaltung mehr erfahren möchten. Der Senior Partner nimmt sich gerne Zeit für Sie.

¹ Die Sharpe-Ratio, auch Reward-to-Variability-Ratio genannt, ist eine Kennzahl und betrachtet die Überrendite, also die Rendite einer Geldanlage, soweit sie den risikofreien Zinssatz übersteigt, in Abhängigkeit vom Risiko. Namensgeber ist William F. Sharpe. Mit der Sharpe-Ratio kann im Nachhinein ein Vergleich zwischen verschiedenen Geldanlagen vorgenommen werden.

Intention der Sharpe-Ratio ist es, die Überrendite pro Einheit des übernommenen Risikos zu messen. Maß für das Risiko ist die Volatilität der Renditen, wobei in die Berechnung der Volatilität alle Renditen eingehen (also auch diejenigen Renditewerte, die unterhalb des risikofreien Zinses liegen).

Weitere Kombinationen

Je nach Risiko, welches Sie als Kunde eingehen möchten, bieten wir auch folgende Anlagestrategien an:

Konservativ:

Long + Absicherung via Futures

Long + Absicherung via Optionen

Aggressiv²:

Long/Short + Futures (directional*)

Diese Liste ist nicht abschliessend: Kontaktieren Sie uns, falls Sie mehr über diese Anlagestrategien und die konkrete Ausgestaltung mehr erfahren möchten. Der Senior Partner nimmt sich gerne Zeit für Sie.

* Abhängig von der Einschätzung der Marktsituation kann der Senior Partner eine Erhöhung des Risikos über Futures tätigen.

² Achtung: Diese Anlagestrategie erlauben wir nur Kunden, die eine sehr hohe Risikotoleranz haben und diese schriftlich bestätigen.