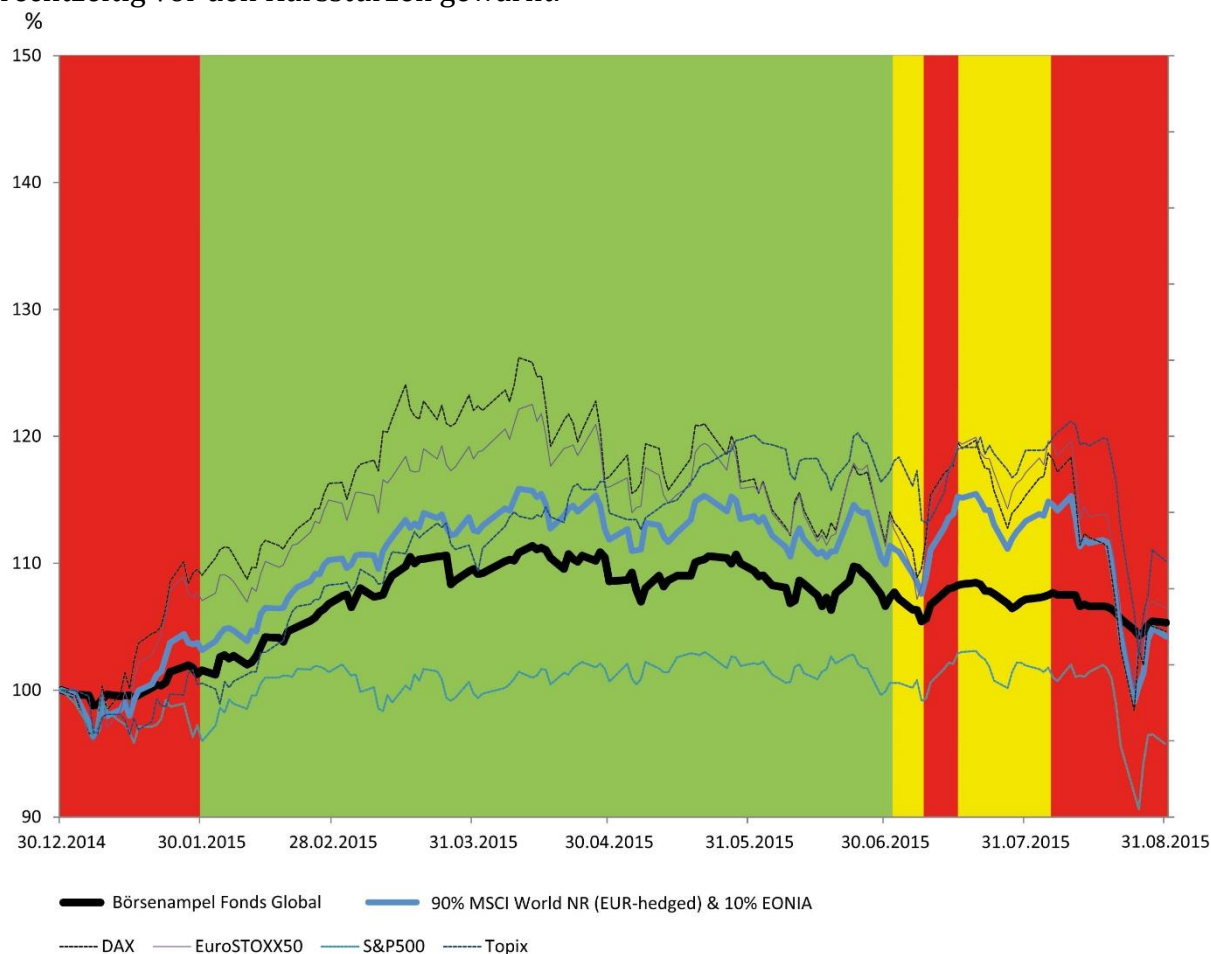


Hamburg, 07. September 2015

VERITAS BÖRSENAMEPEL HAT PRAXISTEST BESTANDEN

Bereits am 06.07.2015 wechselte die Veritas Börsenampel von Grün auf Gelb und ist seit dem 03.08.2015 permanent Rot. Sie signalisierte damit bereits Anfang Juli schwierige Zeiten für die globalen Aktienmärkte (siehe Grafik). Ähnlich wie im Backtest, als die Ampel bereits im August 2008 auf Rot umsprang, hat sie nun auch im Echteininsatz rechtzeitig vor den Kursstürzen gewarnt.



„Das Signal verwendet statt statischer Perioden für die gleitenden Durchschnitte so genannte Adaptive Lookback Indikatoren. Das bedeutet, dass die glättende Wirkung der Indikatoren sich dynamisch an die jeweilige Marktsituation anpassen kann, abhängig vom Abstand der Wendemarken in den Märkten. Das macht die Indikatoren flexibler als herkömmliche, statische Ansätze wie zum Beispiel die 200-Tagelinie“ beschreibt Hauke Hess, zuständiger Geschäftsführer für das Portfolio Management bei Veritas Institutional, die Systematik des Börsenampelfonds.

Erfunden wurde das Börsenampelsignal von vier Hamburger Jungunternehmern, die während ihres Studiums im Hanseatischen Börsenkreises (HBK) aktiv waren. Die Veritas Institutional GmbH hat die exklusiven Nutzungsrechte für die Börsenampel erworben.

Seit Mitte 2014 verwaltet Veritas Institutional Mandate mit Hilfe der Börsenampel. Hierbei wird kundenspezifisch analysiert, für welche Portfoliobestandteile/-strategien die Börsenampel als Signalgeber für die Overlaysteuerung eingesetzt werden kann. „Die Börsenampel ist nicht die berühmte Glaskugel, aber es ist der nach unseren Erkenntnissen beste Weg, um Aktieninvestments und ruhigen Nachtschlaf der Investoren in Einklang zu bringen. Es geht uns um ein ausgewogenes Verhältnis zwischen Performance und Risiko und nicht um eine permanente Outperformance.“, so Dr. Dirk Rogowski, Sprecher der Geschäftsführung von Veritas Institutional. „Insbesondere in Kombination mit Risk@Work ist die Börsenampel ein idealer Weg zur Risikosteuerung von Aktienportfolien. Hierbei lassen sich aktive Manager ohne Probleme in die Steuerungslogik integrieren.“

Ein standardisiertes Beispiel für den Einsatz des Ampelsystems ist der Börsenampel Fonds Global (I) (ISIN DE000A1W2AE5), ein Publikumsfonds der Schwestergesellschaft Veritas Investment, der seit 2014 von Veritas Institutional verwaltet wird. Der Fonds setzt die vom Ampelsignal vorgegebene Investitionsquote mit kostengünstigen Futures um und investiert gleichgewichtet in den DAX, den EuroSTOXX 50, den S&P 500 und den Topix. Der Einsatz der Börsenampel führte zu einer Fondspersformance per 31.08.2015 von 5,89 Prozent seit dem 01.01.2015. Im Vergleich dazu verzeichnet die interne Fondsbenchmark (90 % MSCI World NR EUR hedged und 10 % Eonia) eine Performance von 4,9 Prozent. Die Volatilität des Fonds liegt mit 9,0 Prozent deutlich unter der Benchmarkvolatilität von 16,1 Prozent.

Veritas Institutional GmbH ist ein Spezialist für institutionelles Asset Management.

Geschäftssitz der Firma ist Hamburg.

Für weitere Fragen steht Ihnen zur Verfügung:

Dr. Dirk Rogowski, Geschäftsführer, Veritas Institutional GmbH

Tel.: +49 40 300 929 175

dr@vi-hh.com

www.veritas-institutional.com