

# REPORTING VERMÖGENSPoolINGFONDS 2



Stichtag: 31. Juli 2023

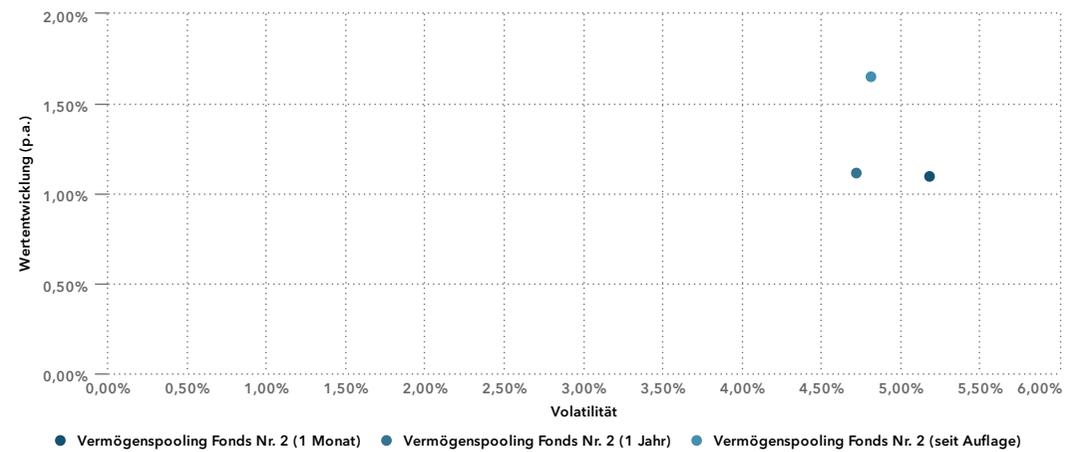
# Wertentwicklung Vermögenspooling Fonds Nr. 2 (STICHTAG: 31.07.2023)

## Wertentwicklung 1 Jahr



Brutto Wertentwicklung nach BVI von 29.07.2022 bis 31.07.2023 (Täglich).

## Rendite-Risiko Matrix



## Wertentwicklung Tabellarisch

| Periode                 | Beginn Periode | Name            |                                | Benchmark       |                                | Aktive Performance |
|-------------------------|----------------|-----------------|--------------------------------|-----------------|--------------------------------|--------------------|
|                         |                | Wertentwicklung | Wertentwicklung (annualisiert) | Wertentwicklung | Wertentwicklung (annualisiert) |                    |
| Freie Periode           | 30.12.2022     | 5,14 % ▲        |                                |                 |                                |                    |
| Vortag                  | 28.07.2023     | 0,03 % ▲        |                                |                 |                                |                    |
| 1 Woche                 | 24.07.2023     | 0,37 % ▲        |                                |                 |                                |                    |
| 2 Wochen                | 17.07.2023     | 0,90 % ▲        |                                |                 |                                |                    |
| 1 Monat                 | 30.06.2023     | 1,10 % ▲        |                                |                 |                                |                    |
| 3 Monate                | 28.04.2023     | 1,73 % ▲        |                                |                 |                                |                    |
| 6 Monate                | 31.01.2023     | 2,60 % ▲        |                                |                 |                                |                    |
| laufendes Kalenderjahr  | 30.12.2022     | 5,14 % ▲        |                                |                 |                                |                    |
| 1 Jahr                  | 29.07.2022     | 1,11 % ▲        |                                |                 |                                |                    |
| 2 Jahre                 | 30.07.2021     | -6,17 % ▼       | -3,13 % ▼                      |                 |                                |                    |
| 3 Jahre                 | 31.07.2020     | 2,78 % ▲        | 0,92 % ▲                       |                 |                                |                    |
| 5 Jahre                 | 31.07.2018     | 7,88 % ▲        | 1,53 % ▲                       |                 |                                |                    |
| seit Auflage            | 02.11.2015     | 13,51 % ▲       | 1,65 % ▲                       |                 |                                |                    |
| laufender Monat         | 30.06.2023     | 1,10 % ▲        |                                |                 |                                |                    |
| laufendes Quartal       | 30.06.2023     | 1,10 % ▲        |                                |                 |                                |                    |
| laufendes Geschäftsjahr | 31.08.2022     | 3,21 % ▲        |                                |                 |                                |                    |
| Kalenderjahr 2022       | 30.12.2021     | -12,06 % ▼      |                                |                 |                                |                    |
| Kalenderjahr 2021       | 30.12.2020     | 6,76 % ▲        |                                |                 |                                |                    |
| Kalenderjahr 2020       | 30.12.2019     | 0,61 % ▲        |                                |                 |                                |                    |

# Kennzahlen des Vermögenspooling Fonds Nr. 2 (STICHTAG: 31.07.2023)

## Übersicht Wertentwicklung und Risikokennzahlen

| Anteilsklasse                | ISIN         | Währung | Kennzahl                       | 3 Jahre  | Seit Auflage |
|------------------------------|--------------|---------|--------------------------------|----------|--------------|
| Vermögenspooling Fonds Nr. 2 | DE000A14N9C5 | EUR     | Wertentwicklung                | 2,78 %   | 13,51 %      |
|                              |              |         | Wertentwicklung (annualisiert) | 0,92 %   | 1,65 %       |
|                              |              |         | Standardabweichung             | 0,30 %   | 0,30 %       |
|                              |              |         | Volatilität                    | 4,74 %   | 4,81 %       |
|                              |              |         | Sharpe Ratio                   | 0,10     | 0,35         |
|                              |              |         | Niedrigster Preis              | 8,88     | 8,88         |
|                              |              |         | Höchster Preis                 | 10,64    | 10,64        |
|                              |              |         | Drawdown                       | -8,01 %  | -8,01 %      |
|                              |              |         | Max. Drawdown                  | -14,09 % | -14,87 %     |
|                              |              |         | Bester Monat                   | 3,87 %   | 3,87 %       |
|                              |              |         | Schlechtester Monat            | -3,56 %  | -9,17 %      |
|                              |              |         | Anzahl Monate > 0              | 23       | 59           |
|                              |              |         | Anzahl Monate < 0              | 13       | 33           |
|                              |              |         | Sortinoratio                   | -0,54 %  | -0,38 %      |

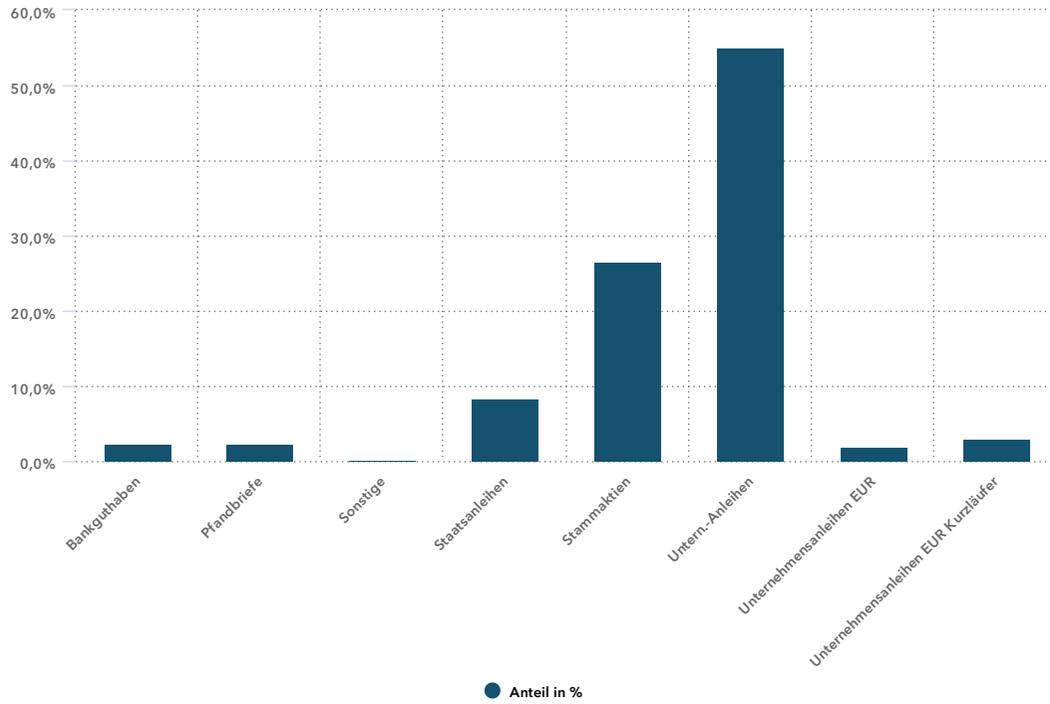
# Asset Allokation Übersicht Vermögenspooling Fonds Nr. 2 (STICHTAG: 31.07.2023)

## Asset Allokation

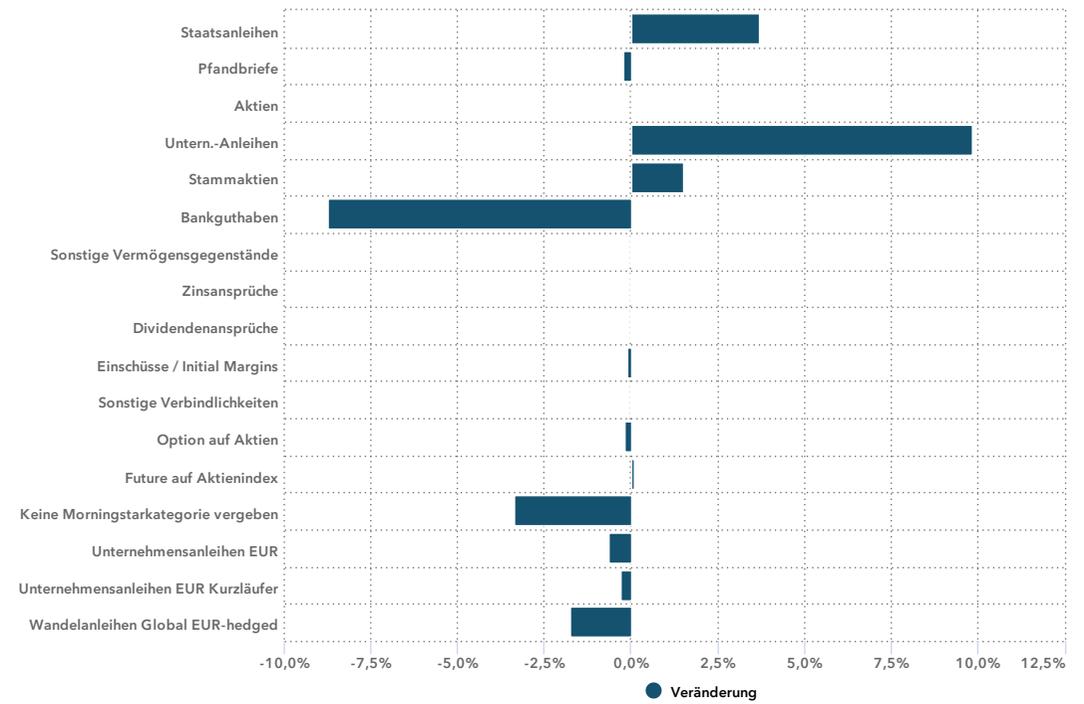
| Vermögenswerte                      | 31.07.2023    |            | 29.07.2022    |            |
|-------------------------------------|---------------|------------|---------------|------------|
|                                     | Marktwert EUR | Anteil NIW | Marktwert EUR | Anteil NIW |
| <b>Aktien</b>                       |               |            |               |            |
| Aktien                              | 309.078,80    | 0,45 % ▲   | 265.053,79    | 0,41 %     |
| Stammaktien                         | 18.287.632,73 | 26,66 % ▲  | 16.353.866,30 | 25,15 %    |
| Summe Aktien                        | 18.596.711,53 | 27,11 % ▲  | 16.618.920,09 | 25,56 %    |
| <b>Renten</b>                       |               |            |               |            |
| Pfandbriefe                         | 1.640.145,78  | 2,39 % ▼   | 1.686.796,91  | 2,59 %     |
| Staatsanleihen                      | 5.739.569,55  | 8,37 % ▲   | 3.039.565,14  | 4,67 %     |
| Untern.-Anleihen                    | 37.777.126,89 | 55,08 % ▲  | 29.402.167,25 | 45,22 %    |
| Summe Renten                        | 45.156.842,22 | 65,84 % ▲  | 34.128.529,30 | 52,49 %    |
| <b>Fonds</b>                        |               |            |               |            |
| Keine Morningstarkategorie vergeben |               |            | 2.191.640,00  | 3,37 %     |
| Unternehmensanleihen EUR            | 1.310.960,00  | 1,91 % ▼   | 1.648.307,50  | 2,53 %     |
| Unternehmensanleihen EUR Kurzläufer | 2.046.200,00  | 2,98 % ▼   | 2.119.200,00  | 3,26 %     |
| Wandelanleihen Global EUR-hedged    |               |            | 1.133.647,27  | 1,74 %     |
| Summe Fonds                         | 3.357.160,00  | 4,89 % ▼   | 7.092.794,77  | 10,91 %    |
| <b>Derivate</b>                     |               |            |               |            |
| Future auf Aktienindex              |               |            | -72.000,00    | -0,11 %    |
| Option auf Aktien                   | -104.160,00   | -0,15 % ▼  |               |            |
| Summe Derivate                      | -104.160,00   | -0,15 % ▼  | -72.000,00    | -0,11 %    |
| <b>Kasse</b>                        |               |            |               |            |
| Bankguthaben                        | 1.643.837,31  | 2,40 % ▼   | 7.239.433,16  | 11,13 %    |
| Dividendenansprüche                 | 3.693,11      | 0,01 % ▲   | 3.268,76      | 0,01 %     |
| Einschüsse / Initial Margins        |               |            | 72.000,00     | 0,11 %     |
| Sonstige Verbindlichkeiten          | -7.376,00     | -0,01 % ▼  | -6.781,00     | -0,01 %    |
| Sonstige Vermögensgegenstände       | -59.443,96    | -0,09 % ▼  | -52.358,10    | -0,08 %    |
| Zinsansprüche                       |               |            | 100,00        | 0,00 %     |
| Summe Kasse                         | 1.580.710,46  | 2,30 % ▼   | 7.255.662,82  | 11,16 %    |
| Summe                               | 68.587.264,21 | 100,00 %   | 65.023.906,98 | 100,00 %   |

# Asset Allokation Übersicht Vermögenspooling Fonds Nr. 2 (STICHTAG: 31.07.2023)

## Asset Allokation



## Prozentuale Veränderung 1 Jahr



## IHR KONTAKT



### Frank Wieser

Geschäftsführer Finanzen

**Telefon:** +49 2241 146408-45

[Frank.Wieser@hausdesstiftens.org](mailto:Frank.Wieser@hausdesstiftens.org)

### Chantal Erdner

Projektmanagerin

**Telefon:** +49 89 744200-983

[Chantal.Erdner@hausdesstiftens.org](mailto:Chantal.Erdner@hausdesstiftens.org)