

FAKTEN

Gewichtung

Gleichgewichtung + Momentumfaktor

Indexmitglieder

12

Startwert

1.000 (seit 15.08.2018)

Min. Gewichtung

3% (at rebalancing)

Max. Gewichtung

none

Rebalancing-Frequenz

quartalsweise

Berechnungs-Frequenz

täglich

Startdatum

15.08.2018

Backtesting Startdatum

01.01.2017

Unser F5 Crypto Index ist der erste wissenschaftliche „State-of-the-Art“ Kryptowährungs-Index. Der Index bildet die Performance seiner 12 Indexmitglieder ab. Die Auswahl der Indexmitglieder basiert auf Marktkapitalisierungen und definierten Ausschlussregeln. Die Gewichtung der Indexmitglieder folgt unserer innovativen finanzwissenschaftlichen Methodik: Gleichgewichtung plus Momentumfaktor.

Index, Bitcoin, Ether und Ripple seit Auflage



Performances des F5 Crypto Index und Krypto-Werten, normalisiert auf 1.000 Pkt. von 15.08.2018 bis 31.12.2021.

INDEX PERFORMANCE

INDEX RENDITEN

	Seit Start (Gesamt)	Seit Start (p.a.)	2019	2020	2021
Indexb. Anlage	965%	101%	25%	184%	323%
Bitcoin	635%	80%	97%	271%	70%
Ethereum	1.206%	114%	-1%	424%	442%

Performance Kennzahlen für den F5 Crypto Index und alternative Krypto-Investments von 15.08.2018 bis 31.12.2021.

DESKRIPTIVE STATISTIKEN

RISIKOMASSE













	Volatilität	Sharpe-ratio	Max. drawdown	Upside frequency	Value-at-Risk 5%	Condition al VaR 5%
Indexb. Anlage	5,01	7,52	92,63	55,65	7,93	14,69
Bitcoin	4,24	7,28	83,40	54,60	6,22	10,32
Ethereum	5,73	8,85	93,96	52,23	7,70	9,57

Risikomaßzahlen für den F5 Crypto Index und alternative Krypto-Investments von 01.01.2017 bis 04.10.2021.

KEY FACTS

- Entwickelt von Professor Hermann Elendner von der Humboldt-Universität zu Berlin.
- 12 Indexmitglieder für eine optimale Intra-Krypto-Diversifikation.
- Quartalsweises Rebalancing garantiert eine dynamische Exposure auf die trendigsten Kryptos.
- Smart Rebalancing reduziert Trading-Kosten.

AKTUELLE 12 INDEXMITGLIEDER

Krypto-Wert	Ticker	Allokation	Vergl. Gewichtung nach Marktkapitalisierung	Index relative Unter-/Übergewichtung vs. Marktkapitalisierung
 Bitcoin	BTC	9,7%	55,42%	-5,7
 Ethereum	ETH	6,0%	26,29%	-4,4
 Cardano	ADA	3,2%	2,26%	1,4
 Binance Coin	BNB	15,7%	4,92%	3,2
 Cosmos	ATOM	2,6%	0,49%	5,3
 Polkadot	DOT	3,4%	1,28%	2,7
 Dogecoin	DOGE	8,9%	1,33%	6,7
 Solana	SOL	3,4%	2,43%	1,4
 Terra	LUNA	18,6%	2,31%	8,1
 Avalanche	AVAX	2,8%	1,49%	1,9
 Shiba Inu	SHIB	3,3%	0,99%	3,3
 Polygon	MATIC	22,4%	0,79%	28,3

F5 Crypto Index Gewichtungen vom 18.04.2022.

REBALANCING METHODIK

- Als Indexmitglieder werden quartalsweise die Top 12 der größten Kryptowerte nach Marktkapitalisierung ausgewählt. Ausgeschlossen werden u.a. Betrugsschemata, Stablecoins und Privacy Coins. Das Top 12 Marktkapitalisierungs-Ranking wird durch einen exponentiell gewichteten, gleitenden Durchschnittswert ermittelt.
- Die 12 Indexmitglieder werden nach der F5 Methodik gewichtet. Ausgehend von einer Gleichgewichtung werden die Allokationen mit ihrem Momentum der letzten Beobachtungsperiode angepasst.
- Das Smart Rebalancing System minimiert Handelsaktivitäten, um Kosten zu sparen. Die finale Gewichtung nach jedem Rebalancing weicht von der Zielgewichtung ab, da sie von der ausgehenden Gewichtung abhängt.

HINWEIS

Dieses Informationsblatt stellt keine Anlageberatung oder Anlagevermittlung dar. Es stellt keine persönlichen Empfehlungen an den Empfänger dar, beruht nicht auf der Prüfung der persönlichen Umstände des Empfängers und ist nicht auf Geeignetheit für den Empfänger geprüft.

Die in diesem Informationsblatt enthaltenen Informationen sind selektiv und erheben keinen Anspruch auf Vollständigkeit. Diese Darstellung enthält keine vollständige Beschreibung der Kryptowährung, der steuerlichen Folgen eines Investments und der mit einer Anlage verbundenen Risiken.

Die Informationen in diesem Informationsblatt spiegeln die Meinung des Autors wider, die auf der Grundlage seiner eigenen Fachkenntnisse, seiner wirtschaftlichen Analyse und der ihm derzeit bekannten Informationen zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Informationsblatts nach bestem Wissen und Gewissen korrekt waren. Der Autor übernimmt jedoch keine weitere Verpflichtung, zusätzliche Informationen zu ermöglichen, dieses Informationsblatt zu aktualisieren oder etwaige hierin enthaltene Ungenauigkeiten zu korrigieren. Die hierin enthaltenen Informationen dürfen unter keinen Umständen so ausgelegt werden, dass sie irgendeine Art von Verpflichtung, Zusicherung, Garantie oder Gewährleistung, ausdrücklich oder stillschweigend, seitens des Autors in Bezug auf das, das Vertrauen auf das, oder die Genauigkeit oder Vollständigkeit des Informationsblatts umfassen. Der Autor übernimmt keine ausdrückliche oder stillschweigende Haftung für die in diesem Informationsblatt enthaltenen Informationen.

Bei der Erstellung von historischen und prognostizierten Informationen wurde mit der gebotenen Sorgfalt vorgegangen. Die tatsächlichen Ergebnisse können jedoch von den Prognosen und Schätzungen abweichen, und jede Abweichung kann erheblich positiv oder negativ sein. Es werden keine Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der zukünftigen Ergebnisse oder anderer zukunftsgerichteter Aussagen gemacht. Solche zukunftsgerichteten Aussagen unterliegen naturgemäß Unsicherheiten und Eventualitäten, von denen viele außerhalb der Kontrolle des Autors liegen. Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein Indikator für zukünftige Ergebnisse.

Grundlage des Angebots ist allein die Satzung der F5 Crypto Fonds 1 InvAG m.v.K., die Anlagebedingungen der F5 Crypto Fonds 1 InvAG m.v.K., das Basisinformationsblatt für semiprofessionelle Anleger und die Zeichnungsunterlagen (einschließlich der „Steuerliche Kurzzangaben“ und „Wesentliche Risikofaktoren“). Vor der Entscheidung für den Erwerb von Anlageaktien sollten potenzielle Anlageaktionäre ihre Bank, ihren Rechtsberater, Steuerberater und/oder Finanzberater konsultieren, und sie sollten die Investitionsentscheidung sorgfältig vor dem Hintergrund dieser Risikofaktoren und ihrer persönlichen Situation abwägen.

Die in dieser Präsentation dargestellten Informationen sind urheberrechtlich geschützt und werden streng vertraulich behandelt. Jeder Empfänger erkennt an und stimmt zu, dass der Inhalt dieses Dokuments (i) urheberrechtlich geschützte und vertrauliche Informationen darstellt, denen der Autor einen unabhängigen wirtschaftlichen Wert zuschreibt, weil sie nicht allgemein bekannt sind, und (ii) Gegenstand angemessener Anstrengungen zur Wahrung ihrer Geheimhaltung sind. Der Empfänger stimmt ferner zu, dass der Inhalt dieses Dokuments ein Geschäftsgeheimnis ist, dessen Offenlegung dem Autor erheblichen und irreparablen Wettbewerbsnachteil verursachen kann. Jede Vervielfältigung oder Verbreitung dieses Dokuments, ganz oder teilweise, oder die Offenlegung seines Inhalts ist ohne die vorherige schriftliche Zustimmung des Autors verboten. Dieses Dokument muss auf Anfrage an den Autor zurückgegeben und alle Kopien vernichtet werden.

BACKTESTED PERFORMANCE

Dieses Dokument enthält Indexperformance-Daten auf der Grundlage von Backtesting, d.h. die Performance des Indexes wird vor dem eigentlichen Start des Indexes theoretisch zurückgerechnet, wobei eine unveränderte Methodik, wie nach dem Start des Indexes, angewendet wird.

Um eine Rückschauverzerrung auszuschließen, sind bei dieser Bewertung keine dynamischen Managemententscheidungen enthalten. Die indexbasierte Anlagestrategie wird ausschließlich auf Basis der Standardparameter ermittelt. Backtesting Performances sind rein hypothetisch und werden in diesem Dokument nur zu Informationszwecken bereitgestellt. Das Backtesting stellt keine tatsächliche Leistung dar und sollte nicht als Indikator für künftige Performances zu Rat gezogen werden.

Stand: Juni 2022

F5 Crypto Management GmbH
Ritterstraße 2A
10969 Berlin

Handelsregister: HRB 226623 B
Registergericht: Amtsgericht Berlin
BaFin-ID: 40031947

Geschäftsführer:
Florian Döhnert-Breyer
Christian Musanke