

Performance Report 01|24

Quantmade Zertifikate



Produktbeschreibung:

Das von der UBS AG emittierte Zertifikat (WKN: UBS1QM) bildet die Performance eines Investmentportfolios ab, bei dessen Zusammensetzung die UBS AG von Quantmade auf Basis der Quant Portfolio Strategien beraten wird. Anleger können durch den Kauf des Zertifikats an der Performance des Portfolios teilhaben. Das Zertifikat wurde Ende Oktober 2023 aufgelegt und ist in Stuttgart und Frankfurt börsengehandelt oder kann direkt bei der UBS erworben werden.

Investmentstrategie:

Das Zertifikat investiert ausschließlich in amerikanische Aktien aus dem S&P 100 (R) und dem Nasdaq 100 (R), die aufgrund ihrer hohen Marktkapitalisierung und Handelsliquidität als weltweit führende Aktien gelten. Die Investmentstrategie basiert auf aktivem, algorithmisch-gesteuertem Trading, die auf der Analyse der Kursentwicklung der Einzelaktien beruht. Es werden Aktien mit einem überdurchschnittlichen Aufwärtspotenzial herausgefiltert und jeweils für einen Zeitraum von ca. 10-20 Tagen gehalten.

Die kürzere Haltedauer und das selektive Investieren reduziert Schwankungen und somit Risiken im Zertifikat und ermöglicht so eine gleichmäßigere Renditeentwicklung. Basierend auf Simulationen mit Vergangenheitsdaten bzw. dem Einsatz der Quant Portfolios in Managed Accounts wird eine mittlere Jahresrendite von ca. 13% (vor Kosten) prognostiziert.

Die Quant Portfolios sind in defensive, ausgewogene und offensive Systeme unterteilt. Derzeit werden nur die defensiven Quant Portfolios eingesetzt. Sollte es auf Basis von Analysen jedoch attraktiver sein, auf offensivere Systeme zu wechseln, wird die Strategie entsprechend angepasst, um eine optimale Gesamtperformance des Zertifikats zu erzielen.

Rechtlicher Hinweis:

Dieses Dokument dient ausschließlich zu Informationszwecken und stellt weder ein Angebot noch eine Aufforderung zur Abgabe eines Angebotes zur Zeichnung oder Erwerb von Anteilen des Partizipationszertifikates noch eine Empfehlung zu deren Erwerb dar. Die hier aufgeführten Informationen ersetzen weder eine geeignete anleger- sowie produktbezogene Anlageberatung noch eine Anlageempfehlung. Alleiner Grundlage für den Anteilserwerb sind die Verkaufsunterlagen. Alle Unterlagen zum Produkt und insbesondere der Verkaufsprospekt, alle Nachträge dazu sowie die endgültigen Bedingungen werden in Übereinstimmung mit den gesetzlichen Bestimmungen auf der Website des Emittenten veröffentlicht (keyinvest-eu.ubs.com). Die Verkaufsunterlagen sind ebenfalls kostenlos bei Quantmade GmbH unter www.quantmade.com und bei Reitelschöfer Vermögensmanagement GmbH unter www.wandelanleihen.de erhältlich. Die ausgegebenen Anteile dieses Zertifikats dürfen nur in solchen Rechtsordnungen zum Kauf angeboten oder verkauft werden, in denen ein solches Angebot oder ein solcher Verkauf zulässig ist. Die Verbreitung und Veröffentlichung dieses Dokuments sowie das Angebot oder ein Verkauf der Anteile dieses Zertifikats können in anderen Rechtsordnungen Beschränkungen unterworfen sein. Sollte dieses Dokument an Dritte weitergeteilt werden, übernehmen Quantmade GmbH und Reitelschöfer Vermögensmanagement GmbH keine weitere Haftung diesbezüglich. Die Gültigkeit der Informationen und Empfehlungen ist auf den Zeitpunkt der Erstellung dieses Dokuments beschränkt und kann sich je nach Marktentwicklung jederzeit und ohne vorherige Ankündigung ändern.

Herausgeber: Quantmade GmbH, Löwenburg 1, 40668 Meerbusch, handelnd als vertraglich gebundener Vermittler (§ 3 Abs. 2 WpIG) im Auftrag, im Namen, für Rechnung und unter der Haftung des verantwortlichen Haftungsträgers Reitelschöfer Vermögensmanagement GmbH, Poppenreuther Straße 144, 90765 Fürth. Die Reitelschöfer Vermögensmanagement GmbH besitzt für die die Erbringung der Anlageberatung gemäß § 2 Abs. 2 Nr. 4 WpIG und der Anlagevermittlung gemäß § 2 Abs. 2 Nr. 3 WpIG eine entsprechende Erlaubnis der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht gemäß § 15 WpIG.

Risikohinweis: Sie sind dem Risiko ausgesetzt, dass der Emittent seine Verpflichtungen aus dem Produkt – beispielsweise im Falle einer Insolvenz (Zahlungsunfähigkeit / Überschuldung) oder einer behördlichen Anordnung von Abwicklungsmaßnahmen – nicht erfüllen kann. Eine solche Anordnung durch eine Abwicklungsbehörde kann im Vorfeld eines Insolvenzverfahrens ergehen. Dabei stehen der Abwicklungsbehörde umfangreiche Eingriffsbefugnisse zu. Unter anderem kann sie die Ansprüche der Anleger bis auf null herabsetzen, das Produkt beenden oder in Aktien des Emittenten umwandeln und Rechte der Anleger aussetzen. Ein Totalverlust des eingesetzten Kapitals ist möglich. Das Produkt unterliegt als Schuldverschreibung keiner Einlagensicherung.

Basis Information

per Stichtag: 02. Februar 2024

ISIN: CH1296716207
WKN: UBS1QM
VALOR: 129671620
EMISSIONSDATUM: 20.10.2023

EMITTENT: UBS AG, Zürich



Performance

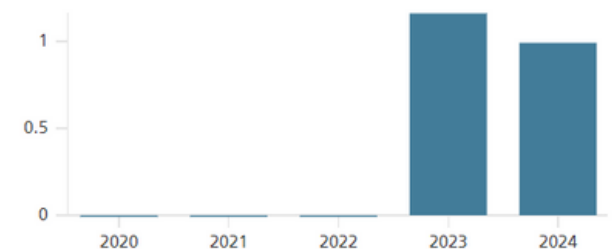
1 Month	0.97%
3 Month	2.04%
6 Month	2.16%
12 Month	2.16%
YTD	0.97%
Since Issue	2.16%

Highs/Lows

	Price	Date
1 Year High	102.26	26-01-2024
1 Year Low	100	31-10-2023
All Time High	102.26	26-01-2024
All Time Low	100	31-10-2023

Annual Returns

2020 - 2024



Monthly Returns (%)

	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	Annual
2024	0,82	0,16											0,99
2023										0,97	0,19		1,16

Simulation Quant Investment Strategie für das AMC

Mittlere Jahresrendite: 13,6%
Mittlere 3-Jahresrendite: 43,2%
Max Drawdown: 15,3%
Alpha (annualisiert): 10,9%
beta: 0,20
Backtest Berechnungszeitraum: 01.01.2004 - 31.12.2023)
Simulationen enthalten keine Kosten

Weitere Informaitonen unter:

<https://zertifikate.ubs.com/produkt/detail/index/isin/CH1296716207>