

Minimum Varianz-Index aus deutschen Mid Cap-Aktien erreicht All-Time-High und lässt MDAX® hinter sich

- **sysShares Mid Cap Germany MinRisk TR Index: + 246,41 % seit 29.12.2006**
- **Mehrertrag gegenüber MDAX® TR Index: 120,86 %-Punkte**
- **Volatilität bei nur rund 80 % der des MDAX®**
- **Partizipation über HVB Open-End-Indexzertifikat möglich**

Hamburg, 10. August 2016 – Mehr Rendite durch weniger Risiko! Der weltweit erste und bis dato einzige Minimum Varianz-Index, der aus den 50 Werten des deutschen Mid Cap-Index MDAX® zusammengesetzt wird, hat zum Börsenschluss am Freitag, den 05. August 2016, mit 127,93 Punkten ein neues All-Time-High erreicht.

Der **sysShares Mid Cap Germany MinRisk TR Index** (ISIN DE000SLA9MR3) des Hamburger Fondsinitiators VILICO Investment erzielte seit dem Start seiner Berechnung am 29.12.2006 eine Wertentwicklung von insgesamt 246,41 % (Rendite p.a.: 13,82 %). Damit liegt er 120,86 %-Punkte vor dem deutschen Mittelstandsindex MDAX®, der 125,55 % erzielte (Rendite p.a.: 8,84 %). Die Schwankungsbreite (Volatilität) lag dabei 21 % unter der des MDAX®.

Wertentwicklung linear, auf 100 indexiert (29.12.2006 bis 05.08.2016)



Mehr Rendite durch alternative, effizient-risikooptimierte Indexkonstruktion

Anders als beim MDAX®, in dem die 50 Indexwerte anhand der Marktkapitalisierung des Streubesitzes und des Orderbuchumsatzes gewichtet werden, erfolgen Titelauswahl und – gewichtung beim MinRisk-Index anhand historischer, finanzmathematischer Risikokennzahlen (Varianz, Kovarianz, Korrelation). Ziel dabei ist, im Rahmen eines quantitativ-regelbasierten und computergestützten Optimierungsprozesses eine möglichst verlustresistente Wertpapiermischung zu erstellen – das so genannte Minimum Varianz-Portfolio. Die Readjustierung des MinRisk-Index erfolgt vierteljährlich.

„Mit dem Ausmaß der in ihrer Höhe nicht prognostizierbaren Kursrückgänge steigt der erforderliche Aufholgewinn überproportional an. Dieser simple mathematische Zusammenhang ist die Ausgangsüberlegung, unserer Portfolio mit einer integrierten Verlustbremse auszustatten“, so Risikomanager Michael Schnoor, der den sysShares® Minimum Varianz-Optimierungsalgorithmus im Rahmen wissenschaftlicher Arbeiten entwickelte.

Seit seiner Berechnung konnte der **sysShares Mid Cap Germany MinRisk TR Index** alle angestrebten Leistungsvorteile gegenüber dem MDAX® erfüllen:

- Systematische Reduzierung der Volatilität bzw. der Kursrückschläge
- Verkürzung der „Leidenszeit“ bis zum Verlustausgleich (Time to Recover)
- Bessere Wertentwicklung über jeden beliebigen 5 Jahreszeitraum

An der Wertentwicklung des **sysShares Mid Cap Germany MinRisk TR Index** können Anleger 1 zu 1 über ein Open-End-Indexzertifikat der HypoVereinsbank / UniCredit Bank AG (ISIN DE000HY41P23) partizipieren. Die laufenden Zertifikatgebühren betragen 1,20 % p.a.

Weitere Informationen unter www.sysShares.com.

Über sysShares® / VILICO

Unter der eingetragenen Marke sysShares® entwickelt der Hamburger Fondsiniciator VILICO Investment Service GmbH quantitativ-risikooptimierte Aktienstrategien auf Basis der Minimum Varianz-Methodik. Leiter des Quant-Teams ist Michael Schnoor, der im Rahmen wissenschaftlicher Arbeiten in den 90er Jahren seinen Minimum Varianz-Optimierungsalgorithmus entwickelte und bis heute in unveränderter Form umsetzt. Derzeit betreibt VILICO drei sysShares® MinRisk-Indizes - auf die Titel des MDAX®, des europäischen Leitindex Euro Stoxx 50® und des japanischen Nikkei 225. Alle drei Indizes sind über HVB Open-End-Indexzertifikate investierbar.

Kontakt für Redakteure & Investoren

VILICO Investment Service GmbH
 Stefan Bülling, Dipl.-Kfm.
 Geschäftsführer
 Tel. 040-822 205 11
 E-Mail: [sb\[at\]vilicoinvest.de](mailto:sb[at]vilicoinvest.de)
 Web: www.vilicoinvest.de
 Friesenstrasse 1
 20097 Hamburg



sysShares®

**...stellt passive Indexfonds
 in den Schatten!**

Risiko- und rechtliche Hinweise

Frühere Wertentwicklungen sind kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung. Die historische Berechnung des sysShares Mid Cap Germany MinRisk TR Index beginnt am 29.12.2006 (Berechnung, Validierung und Zertifizierung der Index-Historie durch Solactive AG). Rückwirkend bis zu diesem Datum werden historische Daten auf täglicher Basis vorgehalten. Der Schlusskurs des Index am 30.06.2014 ist 100. Mit 100 startet die Berechnung des Index am 01.07.2014. Indexleitfaden bei Solactive abrufbar unter: <http://www.solactive.com/de/?s=mid%20cap&index=DE000SLA9MR3>

Zertifikate sind Schuldverschreibungen. Bei einer Insolvenz des Emittenten UniCredit Bank AG drohen Verluste bis hin zum Totalverlust. Details sowie Chancen und Risiken aller genannten Produkte sind den jeweiligen Produktunterlagen zu entnehmen. Allein maßgeblich sind der Basisprospekt und die Endgültigen Bedingungen, die bei der HypoVereinsbank / UniCredit Bank AG unter www.onemarkets.de heruntergeladen werden können.

| sysShares® Minimum Varianz-Indizes | WKN | Zertifikat | Anlageuniversum |
|---|--------------|---------------------|--------------------------|
| sysShares Mid Cap Germany MinRisk TR Index | SLA9MR | HY41P2 | MDAX TR |
| sysShares Large Cap Europe MinRisk TR Index | SLA0G8 | HY816C | Euro Stoxx 50 TR |
| sysShares Large Cap Japan MinRisk TR Index | SLA0G7 | HY82QP | Nikkei 225 TR |