



Pressemitteilung

f-fex AG bringt neues, innovatives Fondsrating auf den Markt

- **Intelligente Ratingmethodik setzt auf neue Kennzahlen und Berechnungsverfahren**
- **Prognosegüte als zentrale Stellgröße des Verfahrens**
- **Einsatz des Ratings in f-fex Portfolio-Advisory Tools**
- **Ratings für Investoren und Berater kostenfrei**

Bad Homburg, 13.03.2019 – Die Frankfurter Fonds Experten der f-fex AG bringen ein neues Fondsrating auf den Markt, das mit modernen Kennzahlen und innovativen Berechnungsverfahren die Bewertung und Auswahl von Fonds signifikant verbessert und erleichtert. Das intelligente quantitative Verfahren nutzt neben der Historie klassischer Performance- und Risikokennzahlen verschiedene zukunftsorientierte Szenariotechniken, die das Ratingsystem in Abhängigkeit der Marktlage und der Besonderheiten einzelner Anlageklassen laufend in Bezug auf seine Prognosegüte optimieren.

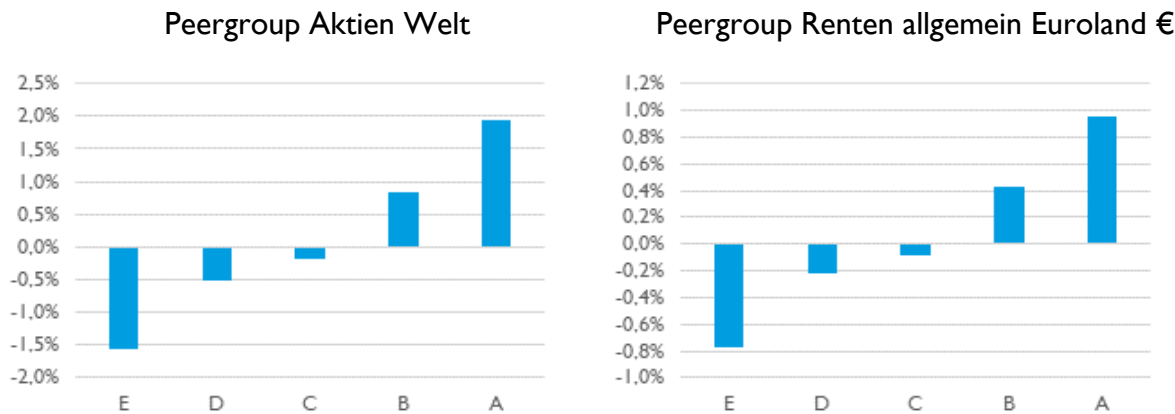
„Die Motivation für die Entwicklung unseres Ratings war die Notwendigkeit, ein aussagefähiges und nachhaltig performancegenerierendes Fondsselektionsverfahren für unsere Robo- und Portfolio-Advisory Tools zu finden“ sagt Dr. Tobias Schmidt, Vorstand und CEO der f-fex AG. „Allerdings hat uns keines der derzeit am Markt verfügbaren Ratings überzeugt, weshalb wir uns entschieden haben, ein eigenes, intelligentes Ratingsystem zu entwickeln. Die damit erzeugten Ratingergebnisse stellen wir nun anderen Investoren und Beratern über finanzen.net und f-fex.de kostenfrei zur Verfügung“, so Schmidt.

Intelligente Ratingmethodik optimiert Prognosegüte

Das f-fex Ratingkonzept wurde entwickelt, um Fonds zu identifizieren, die mit vertretbarem Risiko eine nachhaltige Überrendite gegenüber ihrer Vergleichsgruppe erzielen. Zentrale Stellgröße für das f-fex Ratingkonzept ist daher die Prognosegüte, die das Rating in Bezug auf die risikoadjustierte Rendite eines Fonds liefert. Die Gewichtung der Ratingindikatoren wird dabei vom System für jede Peergroup laufend überprüft und gegebenenfalls angepasst. Im Ergebnis ergeben sich damit jeweils Peergroup-eigene Indikatorgewichte, die sich im Zeitverlauf ändern und so die optimale Aussagekraft des Ratings gewährleisten.

Die höchste Prognosegüte zeigt sich dabei naturgemäß auf den kürzesten Zeitraum, d.h. 1 Jahr. Aber auch auf die 3- und 5-Jahresperspektive liefert das Ratingsystem für die wichtigsten Anlageklassen bzw. Peergroups sehr zufriedenstellende Ergebnisse. „Selbstverständlich ist ein gutes Rating von heute noch keine hundertprozentige Garantie dafür, dass der betreffende Fonds morgen der Top-Outperformer sein wird“, so Schmidt. „Wenn unsere Ratings aber im Durchschnitt die Wahrscheinlichkeit erhöhen, dass wir mit gut oder sehr gut gerateten Fonds tatsächlich Outperformance generieren können, sind wir überaus zufrieden. Unsere intelligente Maschine erspart uns da viel händische Analysearbeit.“

Prognosegüte des Ratings nach 3 Jahren (Outperformance p.a. vs. Durchschnitt)



Das f-fex Rating umfasst alle Fonds bzw. Fondsanteilklassen mit einer Fondshistorie von mindestens 5 Jahren und Zugehörigkeit zu einer hinreichend homogenen Vergleichsgruppe (Peergroup) von mindestens 20 Fonds. Alle Anteilklassen eines Fonds werden separat bewertet. Zum 28.02.2019 haben demnach 4.230 Fonds bzw. 10.775 Anteilklassen in 60 Peergroups ein f-fex Rating.

Das Rating basiert auf 3 Renditeindikatoren und 4 Risikoindikatoren, deren jeweilige Ausprägung entweder auf einer historischen Datenreihe (Rückblick) basiert oder als Szenario-Berechnung (Ausblick) generiert wird. Das Rating selbst wird jeweils zum Monatsultimo berechnet. Die Ergebnisse werden in 5 Ratingklassen von A (sehr gut) bis E (schwach) unterteilt. Weitere Details zur [Rating-Methodik](#) sind auf der f-fex Website zu finden.

Nutzen und Nutzung

Das Rating findet einen ersten Verwendungsniederschlag in den f-fex Portfolio-Advisory Tools „PAUL“ (für Fondspolizen) und „INA“ (für Fondsdepots). Auch für die neue Robo-Advisor Plattform, deren Start für das erste Quartal 2019 geplant ist, wird das f-fex Rating als Selektionsunterstützungstool zur Verfügung stehen.

Die kostenfreie Veröffentlichung der Ratings soll jedoch auch für jene Marktakteure Nutzen stiften, die die f-fex Portfolio-Advisory Tools nicht einsetzen. Die Ratings sind ab sofort kostenfrei auf den Websites von [f-fex](#) und [finanzen.net](#) abrufbar. Darüber hinaus können die Ratings als Datenfile von f-fex bezogen werden. Für Fondsgesellschaften stehen zur werblichen Nutzung der Ratingsiegel verschiedene Lizenzmodelle zur Verfügung.

Über f-fex:

f-fex ist der erste Komplett-Anbieter für das digitale Management von Fondspolizen und Fondsdepots. Das Mitte 2017 von erfahrenen Vorständen und Managern gegründete Unternehmen bündelt einzigartiges Fonds- und Versicherungs-Know-how. Mit ihren digitalen Lösungen stärkt die f-fex AG das Fondspolizen-Geschäft der Versicherer und unterstützt Berater und Vermittler dabei, ihre Kunden mittels intelligenter Portfolio-Advisory Tools effizient und renditeorientiert zu beraten. Darüber hinaus schafft f-fex intelligente Lösungen für das fondsbasierte Vermögensmanagement von Vermögensverwaltern und Finanzvertrieben.

Pressekontakt:

f-fex AG, Dornbachstraße 1a, 61352 Bad Homburg
Tel.: +49 (0)6172 2655-372
Mail: presse@f-fex.de, Internet: <http://www.f-fex.de>