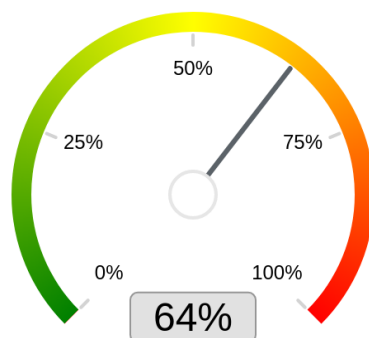


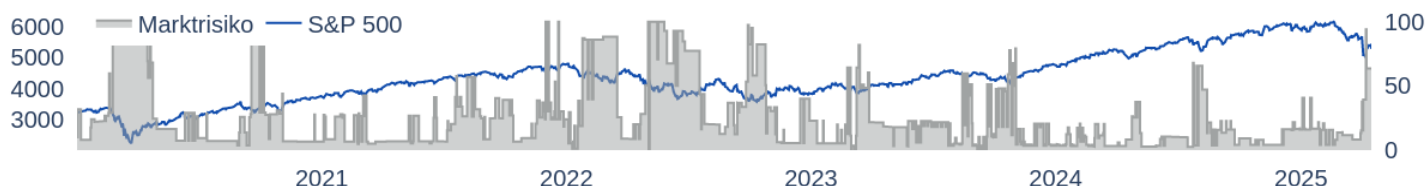
## Marktrisiko im US-Markt



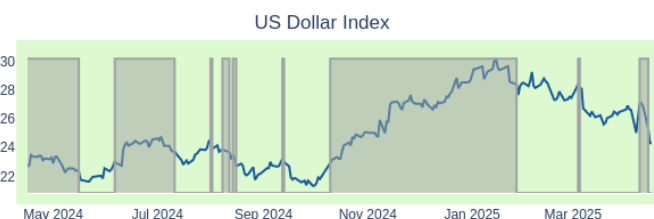
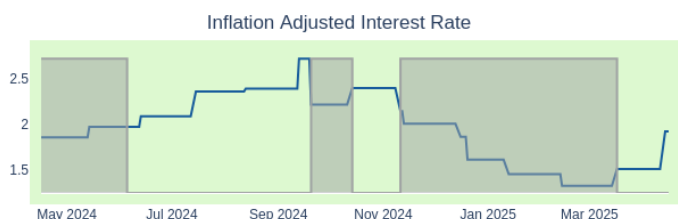
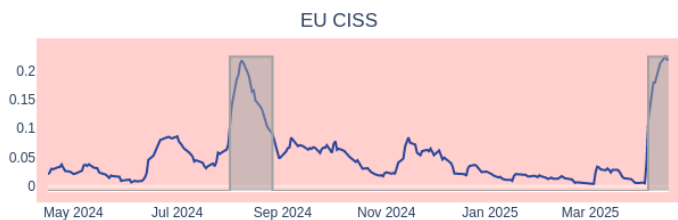
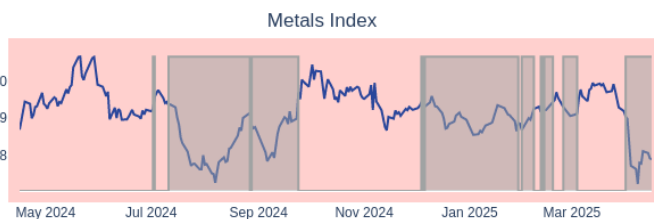
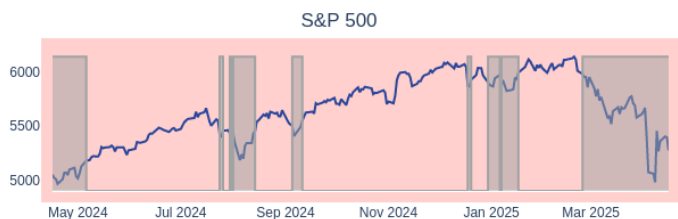
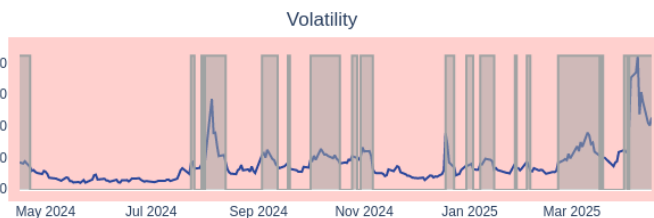
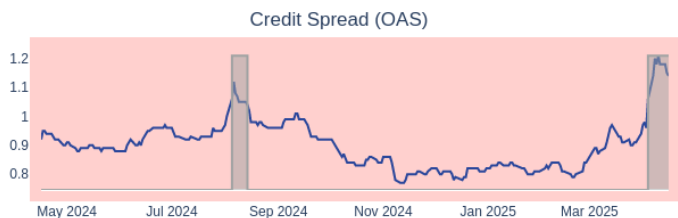
### Historisches Marktrisiko

Vortag: 64%  
Vorwoche: 64%  
Vormonat: 12%

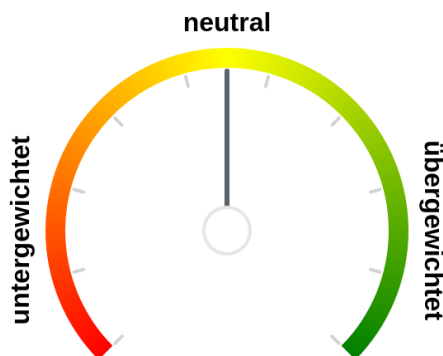
**Wir sind im High-Risk Modus.**



## Auswahl von Marktindikatoren



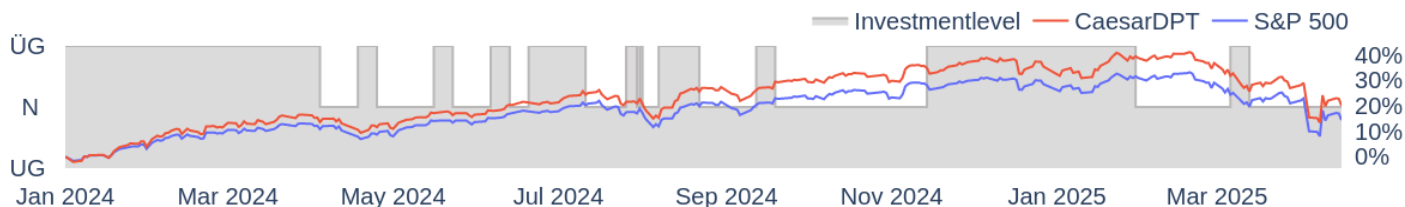
## Investmentlevel auf dem US-Markt



## Historisches Investmentlevel

|           |         |
|-----------|---------|
| Vortag:   | neutral |
| Vorwoche: | neutral |
| Vormonat: | neutral |

Das Investmentlevel ist neutral.



## Glossar

## Marktrisiko

Das CaesarDPT Marktrisiko wird auf Basis verschiedener, voneinander unabhängiger Marktindikatoren berechnet und auf einer Skala von 0% - 100% dargestellt. Es gibt an, wie oft das aktuelle Umfeld, definiert durch die ausgewerteten Finanzmarktindikatoren, zu großen Drawdowns geführt hat. Low-Risk steht für ein Umfeld, in dem es typischerweise nicht zu großen Drawdowns gekommen ist, High-Risk für ein Umfeld, in dem es häufig zu großen Drawdowns gekommen ist. Das Marktrisiko ist also ein Drawdown-Indikator.

## Investmentlevel

Auf Basis des CaesarDPT Marktrisikos und weiterer Marktindikatoren berechnet CaesarDPT täglich das optimale Investmentlevel für den S&P 500. Im Low-Risk Modus variiert das Investmentlevel zwischen untergewichtet und neutral, im High-Risk Modus zwischen neutral und übergewichtet. Das Investmentlevel ist also ein risikogewichteter Performance-Indikator.

## DISCLAIMER

Der Inhalt des Marktrisiko Reports von CaesarDPT und der Webseiten von "www.privatealpha.ai" dient ausschließlich Informationszwecken und stellt weder eine Anlageberatung noch eine Empfehlung oder Aufforderung zum Kauf oder Verkauf des jeweiligen Index dar, noch ist er Grundlage für einen Vertrag oder eine Verpflichtung irgendeiner Art. Für die Richtigkeit der Daten wird keine Haftung übernommen. Börsentransaktionen sind mit Risiken verbunden, die Sie kennen müssen und die die Konsultation eines professionellen Anlageberaters oder Finanzdienstleisters erfordern. Bitte wenden Sie sich vor jeder Handelsaktivität mit den hier vorgestellten Wertpapieren oder Indizes an die Bank Ihrer Wahl!

Private Alpha entwickelt Indexregelwerke und lizenziert diese z.B. an Banken und Vermögensverwalter. Wir möchten darauf hinweisen, dass Private Alpha mit den Private Alpha Indizes Lizenzeinnahmen erzielt und diese auch anstrebt. Alle Wertpapiere sind oder können Bestandteil der Private Alpha Fonds und/oder Zertifikate sein.

Die gewählten und dargestellten Indikatoren dienen nur der Illustration der Arbeitsweise von CaesarDPT und müssen nicht den aktuell effektiv benutzten Zeitserien entsprechen. Es besteht kein Anspruch auf Vollständigkeit der zugrundeliegenden Daten.

