

SCHERBIUS ANALYTICS UG
(HAFTUNGSBESCHRÄNKT)

Scherbius 1.3 Institutionell

Quantitative Portfoliostrategien für Institutionelle- und
Privatanleger

BENCHMARK NASDAQ-100 (Total Return)

AUFLEGUNG 02. Januar 2015

STICHTAG 18. May 2026

STARTKAPITAL 10.000 €

BACKTEST 01/2015 – 12/2025

LIVE AB 15.12.2025

GESAMTRENDITE
(NETTO)

+3.471%

NDX: +584%

CAGR
(NETTO)

36,9%

NDX: 18,4%

SHARPE
RATIO

2,75

NDX: 0,84

MAX
DRAWDOWN

-12,5%

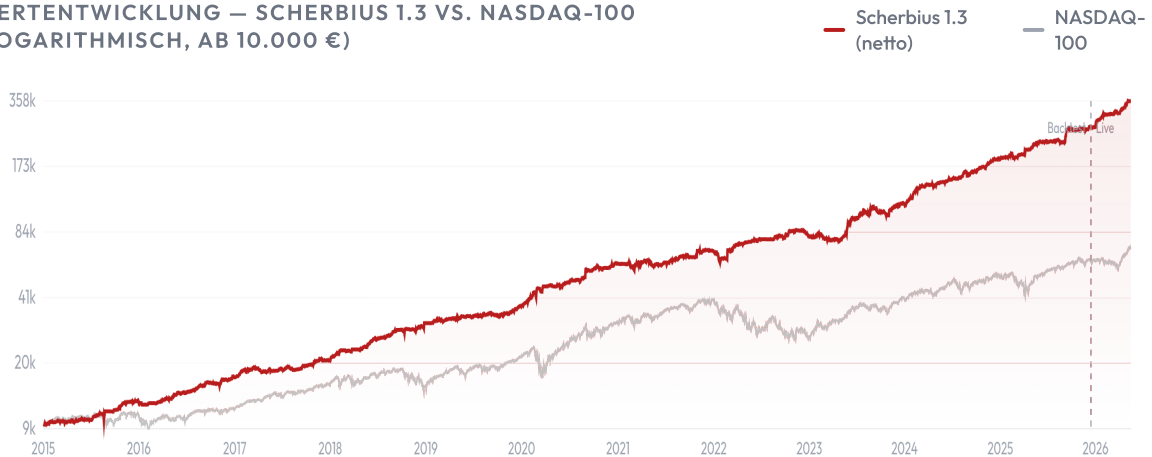
NDX: -35,6%

ENDWERT (NETTO)

357.116 €

aus 10.000 € Startkapital

WERTENTWICKLUNG — SCHERBIUS 1.3 VS. NASDAQ-100
(LOGARITHMISCH, AB 10.000 €)



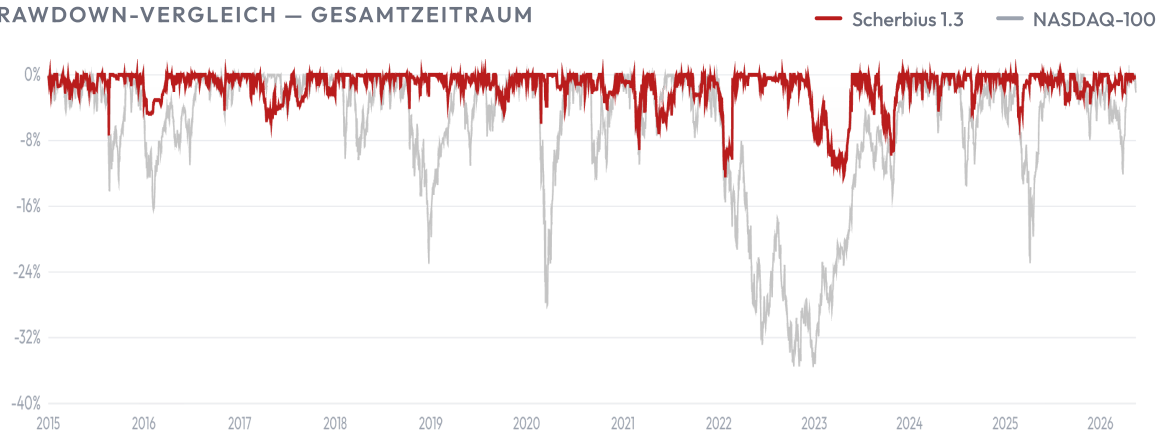
RENDITE & WACHSTUM

KENNZAHL	PORTFOLIO	NASDAQ-100
Gesamtrendite	3.471%	584%
CAGR	36,94%	18,42%
Ø Rendite p.a.	35,66%	19,80%
Profit Factor	1,71	1,17
Trefferquote	65,1%	56,0%

RISIKO & DRAWDOWN

KENNZAHL	PORTFOLIO	NASDAQ-100
Sharpe Ratio	2,745	0,842
Sortino Ratio	0,287	0,079
Volatilität (ann.)	13,7%	22,2%
Max Drawdown	-12,5%	-35,6%
Ø DD Tiefe	1,1%	2,7%
Max DD Dauer	133 Tage	519 Tage

DRAWDOWN-VERGLEICH — GESAMTZEITRAUM



PERFORMANCE SEIT AUFLAGE (15.12.2025) — KUMULIERT VS. NASDAQ-100

— Scherbius 1.3 (netto) — NASDAQ-100

PORTFOLIO (NETTO)

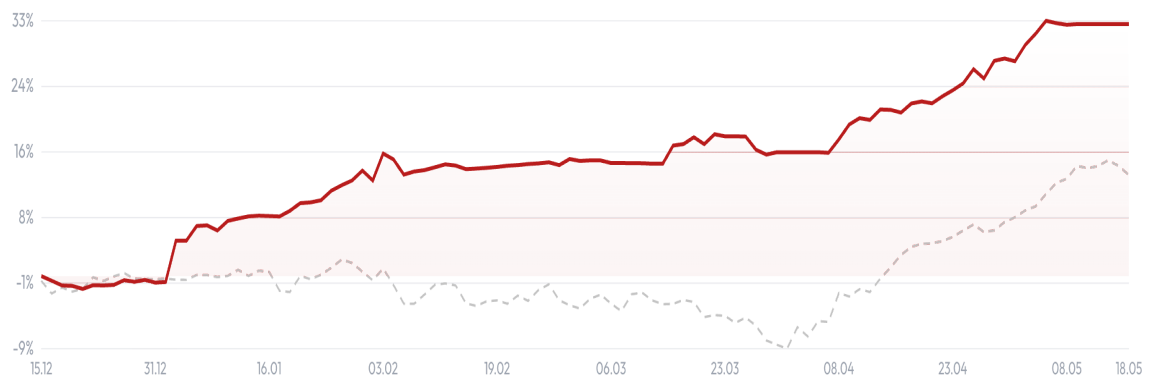
+32,36%

NASDAQ-100

+12,99%

OUTPERFORMANCE

+19,37%



JAHRESRENDITEN (NETTO, NACH STEUERN & TRANSAKTIONSKOSTEN)

✓ NETTO · NUR AKTIEN · KEIN HEBEL

2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	2024	2025	2026*
+28,6%	+30,4%	+20,4%	+51,2%	+20,1%	+61,7%	+14,1%	+17,9%	+44,3%	+64,1%	+42,0%	+33,5%
NDX +8,6%	NDX +5,9%	NDX +31,5%	NDX -1,0%	NDX +38,0%	NDX +47,6%	NDX +26,6%	NDX -33,0%	NDX +53,8%	NDX +24,9%	NDX +20,2%	NDX +14,6%

Scherbius 1.3 Institutionell ist ein regelbasiertes, quantitatives Aktienmodell der Scherbius Analytics UG (haftungsbeschränkt), das systematisch in Aktien des NASDAQ-100-Universums investiert. Das Modell handelt ausschließlich Aktien (kein Derivateinsatz, Gross Leverage: 1x). Alle ausgewiesenen Renditen verstehen sich **netto nach Abzug sämtlicher Transaktionskosten und nach Steuern** (Kapitalertragsteuer 25% zzgl. Solidaritätszuschlag 5,5%, effektiv 26,375%) auf Basis eines Startkapitals von 10.000 €.

Risikohinweis: Die Wertentwicklung vom 01.01.2015 bis 14.12.2025 basiert auf einem simulierten Backtest unter Verwendung historischer Kursdaten. Backtests unterliegen methodischen Einschränkungen und spiegeln nicht zwangsläufig die tatsächliche Handelsperformance wider. Ab dem 15.12.2025 wird die Performance live gemessen. Vergangene Wertentwicklungen – ob simuliert oder tatsächlich erzielt – sind kein verlässlicher Indikator für zukünftige Ergebnisse. Das Modell investiert ausschließlich in Aktien des NASDAQ-100-Universums ohne Derivateinsatz. Dieses Dokument stellt keine Anlageberatung, keine Aufforderung zum Kauf oder Verkauf von Finanzinstrumenten und kein Angebot im Sinne des WpHG dar. Anleger sollten vor einer Investitionsentscheidung eine unabhängige professionelle Beratung einholen.