

# Talent-Hotel: Due Diligence Questionnaire

## I. Allgemeine Angaben

Name des Managers
Anschrift:
Name des Produkts:
Strategie des Produkts:
Investmentziel
Datum:

**HINWEIS:** Bitte beantworten Sie alle nachfolgenden Fragen primär **mit Blick auf die von Ihnen vorgeschlagene Strategie!** Sofern einzelne Fragen im Hinblick auf Ihr spezifisches Investmentkonzept redundant sind, vermerken Sie dies bitte explizit mit einer kurzen Begründung.

## II. Produkt

### II. 1. Investmentphilosophie

1. Beschreiben Sie Ihre Investmentphilosophie.
2. Beschreiben Sie Investmentstrategie.
3. Aufgrund welcher Tatsachen bzw. Ereignisse treffen Sie Ihre Entscheidungen? Welche Rolle spielen EDV-Systeme in der Strategie?
4. Beschreiben Sie bitte den Handelsprozess für die Strategie. Welche Handelstechniken kommen zum Einsatz? Erfolgt der Handel elektronisch/ über Broker/ Program Trades? Wie hoch ist der Turnover am Tag?
5. Beschreiben Sie Ihren Research-Ansatz und -prozess. Welche Analyse- und Informationssysteme benötigt ihr Research/ Portfoliomanagement?
6. Wo liegen die Stärken und Schwächen des Produktes in verschiedenen Marktgegebenheiten (Volatilitäten, Korrelationen, Trends, Zinssätze u.ä.)?
7. Gibt es eine Kapazitätsgrenze für das Produkt? Wenn ja, wie hoch und warum?

## **II.2. Performance/ Backtest**

8. Welches Rendite-Risiko-Profil haben Sie für den Ansatz definiert?
9. Über welchen Zeitraum erstreckt sich der Backtest der Strategie?
10. Wie ist Ihr Backtest-Verfahren aufgebaut?
11. Haben die Backtest-Ergebnisse zu einer Änderungen/ Neujustierung des Investmentansatzes geführt?  
Wenn ja, zu welchen?

## **II.4. Einzigartigkeit/ Kompetitiver Vorteil des Investmentansatzes**

12. Bitte beschreiben Sie den kompetitiven Vorteil des Produktes gegenüber anderen Strategien gleicher Stilrichtung.
13. Gibt es dieses Produkt in ähnlicher Form schon? Wenn ja unter welchem Namen und wo liegen die Unterschiede?

## **III. Risikomessung & -management**

14. Geben Sie bitte an, welche Art von Risiken sie für ihre Strategie sehen und wie sie diese Risiken handhaben wollen?

## **IV. Zur Person/ Team**

15. Über wie viele Jahre Berufserfahrung im Portfoliomanagement/ Handel verfügen Sie?
16. Gab es von Ihnen oder einer am Produkt beteiligten Person Publikationen oder Presseartikel zu dem Produkt? Wenn ja, geben Sie diese bitte an.
17. Welche beruflichen Vorbilder haben Sie (Händler, Portfolio Manager) bzw. welche Leistung im Asset Management hat sie in den letzten Jahren am meisten beeindruckt?

Vielen Dank für die Darstellung Ihrer Investment-Strategie.