

iquant AktienInvestor Deutschland

Basisdaten		
Outperformance		1.172 % (11,95 % p.a.)
Transaktionen		447 (24,8 p.a.)
Benchmark		DAX P
	Benchmark	Strategie
Kapital		
Start 01/2000	1.000.000 EUR	1.000.000 EUR
Ende 12/2017	1.913.509 EUR	13.637.034 EUR
Rendite		
Rendite p.a. (geo.)	3,67 %	15,62 %
Rendite 2016	6,87 %	1,64 %
Rendite 2017 YTD	12,51 %	18,81 %
Risiko		
Maximaler Rückgang	-72,68 %	-14,27 %
Mittlerer Rückgang	-24,05 %	-2,86 %
Volatilität p.a.	20,88 %	10,82 %
Längste Verlustperiode	7,31 J.	1,34 J.
Rendite zu Risiko		
Rendite / Max. Rückgang	0,05	1,09
Rendite / Mittel Rückgang	0,15	5,45
Rendite / Volatilität p.a.	0,18	1,44

Beschreibung

Die von iquant im Jahr 2012 entwickelte Anlagestrategie besteht aus vier Elementen: Ein Momentum-Algorithmus filtert aus dem deutschen Midcap-Index MDAX® die statistisch jeweils aussichtsreichsten Aktien heraus. Ein weiterer Baustein sind Turnaround-Aktien aus dem Blue Chip Index DAX®.

In schwachen Börsenphasen kann das gesamte Portfolio durch zwei zusätzliche Strategieelemente marktneutral oder short ausgerichtet werden. Dabei kommen trendfolgende und saisonale Logiken zum Einsatz.

