

iquant LowBeta SuperSectors EUR

Basisdaten		
Outperformance		225 % (5,02 % p.a.)
Transaktionen		127 (7,1 p.a.)
Benchmark		STX 600 € R
	Benchmark	Strategie
Kapital		
Start 01/2000	1.000.000 EUR	1.000.000 EUR
Ende 12/2017	1.657.339 EUR	3.906.741 EUR
Rendite		
Rendite p.a. (geo.)	2,85 %	7,86 %
Rendite 2016	1,21 %	-2,58 %
Rendite 2017 YTD	10,58 %	7,52 %
Risiko		
Maximaler Rückgang	-58,69 %	-16,32 %
Mittlerer Rückgang	-20,13 %	-4,33 %
Volatilität p.a.	15,12 %	8,03 %
Längste Verlustperiode	6,52 J.	2,87 J.
Rendite zu Risiko		
Rendite / Max. Rückgang	0,05	0,48
Rendite / Mittel Rückgang	0,14	1,82
Rendite / Volatilität p.a.	0,19	0,98

Beschreibung

Das System investiert in ETF auf ausgewählte europäische Branchenindizes des Stoxx 600® (SuperSectors). Die Investition erfolgt nur, wenn auch der Gesamtmarkt einen langfristigen Aufwärtstrend aufweist. Als Zusatzbedingung ist zudem ein Low-Beta-Filter definiert, da die Anlage nur in defensive Branchen erfolgen soll.

Ein weiteres Auswahlkriterium für die Aufnahme eines Branchenindex-ETF in das Portfolio ist zudem ein mittelfristiger Aufwärtstrend des jeweiligen Sektors, was über entsprechende Trendfilter geprüft wird. Zur Risikoreduktion wurden Trailing-Stops definiert.

