

iquant LowBeta SuperSectors USD

Basisdaten			Beschreibung
Outperformance		179 % (3,79 % p.a.)	
Transaktionen		127 (7,1 p.a.)	
Benchmark		STX 600 € R	
	Benchmark	Strategie	
Kapital			Another selection criterion for including a sector index ETF in the portfolio is that sector's upward trend in the medium term, checked via appropriate trend filters. Trailing stops are specified to reduce risk.
Start	01/2000	1.000.000 USD	
Ende	12/2017	1.971.090 USD	3.761.242 USD
Rendite			
Rendite p.a. (geo.)		3,84 %	7,64 %
Rendite 2016		-2,35 %	-3,72 %
Rendite 2017 YTD		25,81 %	22,02 %
Risiko			
Maximaler Rückgang		-63,19 %	-17,94 %
Mittlerer Rückgang		-19,11 %	-6,69 %
Volatilität p.a.		18,30 %	9,41 %
Längste Verlustperiode		6,34 J.	3,78 J.
Rendite zu Risiko			
Rendite / Max. Rückgang		0,06	0,43
Rendite / Mittel Rückgang		0,20	1,14
Rendite / Volatilität p.a.		0,21	0,81

