

iquant MULTI-Strategie EUR

Basisdaten		
Outperformance	2.139 % (15,44 % p.a.)	
Transaktionen	1188 (66,0 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	23.307.814 EUR
Rendite		
Rendite p.a. (geo.)	3,67 %	19,11 %
Rendite 2016	6,87 %	10,44 %
Rendite 2017 YTD	12,51 %	21,63 %
Risiko		
Maximaler Rückgang	-72,68 %	-14,71 %
Mittlerer Rückgang	-24,05 %	-3,67 %
Volatilität p.a.	20,88 %	12,22 %
Längste Verlustperiode	7,31 J.	1,44 J.
Rendite zu Risiko		
Rendite / Max. Rückgang	0,05	1,30
Rendite / Mittel Rückgang	0,15	5,21
Rendite / Volatilität p.a.	0,18	1,56

Beschreibung

Diese Dach-Strategie kombiniert Dividenden-, Momentum-, Trendfolge- und Saisonal-Ansätze. Dabei kommen zwei Verfahren zur Auswahl dividendenstarker DAX®-Aktien zum Einsatz, dazu zwei Strategien zur momentum-basierten Selektion von Aktien aus dem HDAX®.

Abgerundet wird das Portfolio durch Titel, die anhand einer Trendfolge-Strategie aus dem NASDAQ100® selektiert werden. Dazu kommen zwei saisonale Timing-Strategien auf DAX® und MDAX®. Alle Strategien investieren entweder direkt Aktien oder in ETF. Einige Strategien können auch auf fallende Kurse setzen, dabei wird zur Umsetzung ein ShortETF ohne Hebel eingesetzt.

