

AktienInvestor DAX und MDAX

Basisdaten		Beschreibung	
Outperformance	924 % (10,73 % p.a.)	Das System wurde 2012 entwickelt und wird seitdem in unveränderter Form an die Captimizer-Anwender ausgeliefert.	
Transaktionen	464 (24,5 p.a.)		
Benchmark	DAX TR		
	Benchmark	Strategie	
Kapital		Das Handelssystem besteht aus vier Strategien, die sich gegenseitig ergänzen. Mit einer Momentum-Strategie wird in die Aktien des MDAX und mit einer Flop-Top-Strategie in die Aktien des DAX investiert. Eine MACD-Strategie und eine saisonale Strategie auf den DAX sichern in bestimmten Marktphasen mit Hilfe von einen gehebelten ShortDAX-ETF die Aktienpositionen ab. Alle Strategien arbeiten unabhängig, so dass ein Long oder Short- oder eine Marktneutrale Positionierung entstehen kann. Da die Aktienpositionen nicht mit Stopps abgesichert sind, werden starke Abwärtsbewegungen des Gesamtmarkt durch die beiden Short-Strategien abgedefert.	
Start 01/2000	100.000 EUR	100.000 EUR	
Ende 12/2018	165.928 EUR	1.089.848 EUR	
Rendite			
Rendite p.a. (geo.)	2,71 %	13,44 %	
Rendite 2017	12,51 %	17,84 %	
Rendite 2018 YTD	-13,29 %	-3,15 %	
Risiko			
Maximaler Rückgang	-72,68 %	-13,85 %	
Mittlerer Rückgang	-23,30 %	-2,82 %	
Volatilität p.a.	20,53 %	9,86 %	
Längste Verlustperiode	7,31 J.	1,76 J.	
Rendite zu Risiko			
Rendite / Max. Rückgang	0,04	0,97	
Rendite / Mittel Rückgang	0,12	4,76	
Rendite / Volatilität p.a.	0,13	1,36	

