

AktienInvestor DAX und MDAX

Basisdaten		Beschreibung	
Outperformance	922 % (10,64 % p.a.)	Das System wurde 2012 entwickelt und wird seitdem in unveränderter Form an die Captimizer-Anwender ausgeliefert.	
Transaktionen	464 (24,3 p.a.)		
Benchmark	DAX TR		
	Benchmark	Strategie	
Kapital			
Start 01/2000	100.000 EUR	100.000 EUR	
Ende 01/2019	165.509 EUR	1.087.513 EUR	
Rendite			
Rendite p.a. (geo.)	2,67 %	13,31 %	
Rendite 2018	-18,26 %	-2,24 %	
Rendite 2019 YTD	5,82 %	-1,15 %	
Risiko			
Maximaler Rückgang	-72,68 %	-13,85 %	
Mittlerer Rückgang	-23,27 %	-2,84 %	
Volatilität p.a.	20,58 %	9,85 %	
Längste Verlustperiode	7,31 J.	1,76 J.	
Rendite zu Risiko			
Rendite / Max. Rückgang	0,04	0,96	
Rendite / Mittel Rückgang	0,11	4,69	
Rendite / Volatilität p.a.	0,13	1,35	

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.

