

iquant MULTI-Strategie EUR V2

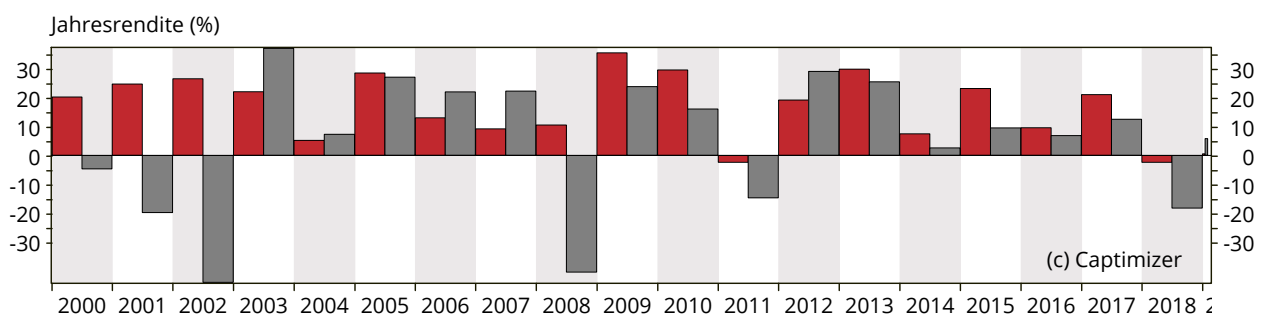
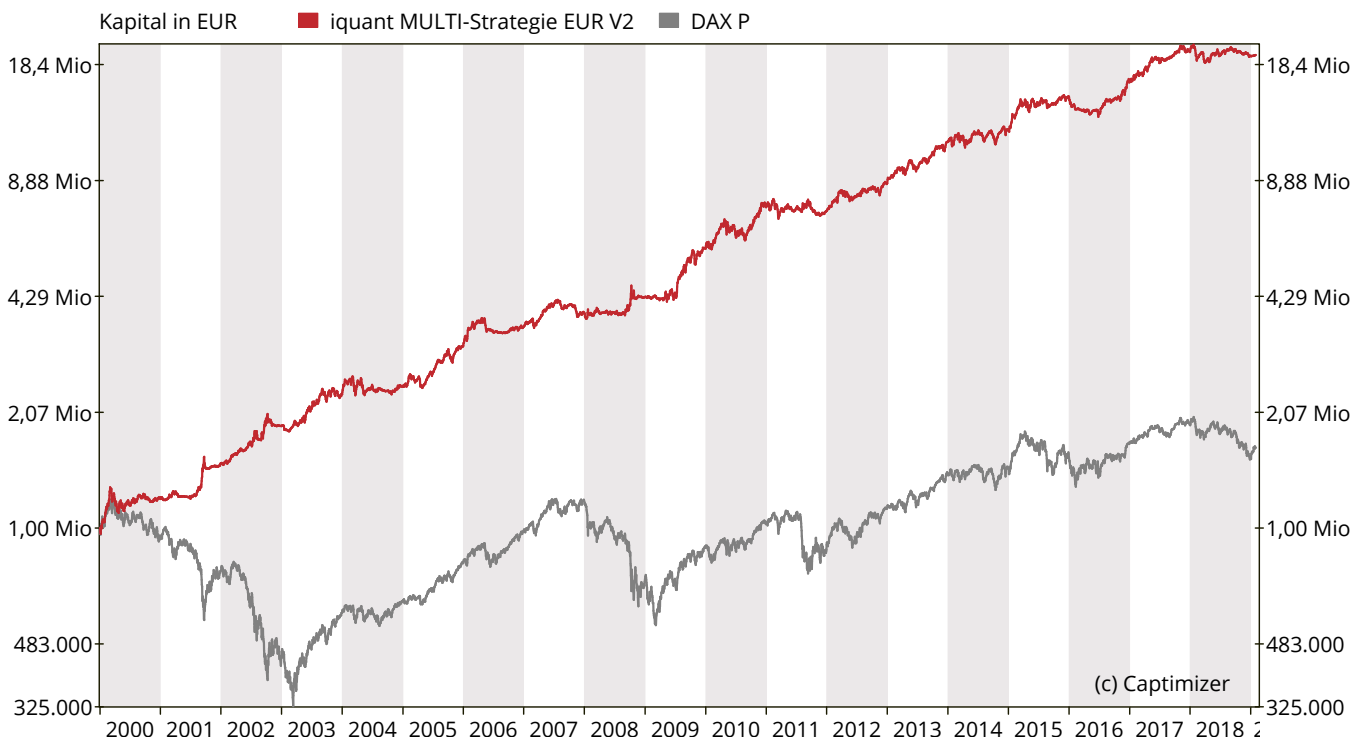
Basisdaten		
Outperformance	1.788 % (14,17 % p.a.)	
Transaktionen	1284 (67,2 p.a.)	
Benchmark	DAX P	
	Benchmark	Strategie
Kapital		
Start 01/2000	1.000.000 EUR	1.000.000 EUR
Ende 01/2019	1.655.088 EUR	19.539.434 EUR
Rendite		
Rendite p.a. (geo.)	2,67 %	16,84 %
Rendite 2018	-18,26 %	-2,41 %
Rendite 2019 YTD	5,82 %	0,60 %
Risiko		
Maximaler Rückgang	-72,68 %	-14,91 %
Mittlerer Rückgang	-23,27 %	-4,06 %
Volatilität p.a.	20,58 %	12,13 %
Längste Verlustperiode	7,31 J.	1,47 J.
Rendite zu Risiko		
Rendite / Max. Rückgang	0,04	1,13
Rendite / Mittel Rückgang	0,11	4,15
Rendite / Volatilität p.a.	0,13	1,39

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 momentumbasierten 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.

Es wurden eine Managementgebühr von 1,19% p.a. und Transaktionskosten von 45€ je Kauf und je Verkauf berücksichtigt.



iquant MULTI-Strategie EUR V2

Chance		4,0
Rendite p.a.	16,84 %	4,0
Outperformance p.a.	14,17 %	5,0
positive Monatsrenditen	62,45 %	4,0
Risiko		2,0
Maximaler Rückgang	-14,91 %	2,0
Mittlerer Rückgang	-4,06 %	1,5
Max. Verlustdauer	1,47 J.	1,0
Volatilität p.a.	12,13 %	2,0
Bequemlichkeit		2,5
Transaktionen p.a.	134,23	2,5
Handelstage p.a.	68,16	2,5
Anlagehorizont		3Jahre
Max. Verlustdauer	1,47 J.	

Max. Transaktionen im Kalenderjahr 218 (2000)

iquant MULTI-Strategie EUR V2

	Jahresrenditen (%)	Monatsrenditen (%)											
		Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez
2000	20,24	3,88	18,36	-2,13	-2,99	-2,72	2,56	0,89	4,63	-0,14	-3,89	2,42	-0,50
2001	24,71	-0,97	2,54	1,67	-1,99	0,05	-1,02	1,43	6,07	12,41	0,51	0,48	1,90
2002	26,54	1,45	1,50	3,62	2,89	-0,57	3,08	5,38	-2,40	14,68	-2,39	-2,35	0,03
2003	22,04	-2,33	1,12	2,26	1,19	6,37	2,40	5,51	4,59	-5,13	6,66	-0,63	-1,18
2004	5,21	8,21	0,96	-3,91	-0,38	-1,82	3,42	-4,07	1,15	-0,81	-0,65	1,62	1,97
2005	28,51	1,76	3,64	-0,77	-5,32	6,78	2,31	7,78	0,84	6,35	-5,08	5,81	2,26
2006	13,03	10,83	2,59	2,52	-0,49	-4,03	-1,85	-0,16	-0,20	0,83	1,58	-0,10	1,46
2007	9,23	2,72	-1,19	2,36	6,04	4,06	-0,15	2,73	-3,75	1,23	-0,22	-5,53	1,14
2008	10,55	-0,64	0,33	1,26	-0,77	0,36	-0,51	-1,05	0,26	5,34	5,04	0,91	-0,22
2009	35,50	-0,22	0,69	-2,09	1,41	1,35	0,35	12,07	4,83	7,48	-4,16	5,94	4,19
2010	29,56	0,05	4,38	8,38	2,96	-2,79	-3,57	0,51	-3,35	8,63	5,60	3,99	2,36
2011	-2,39	-1,20	3,09	-3,45	2,09	-0,18	-0,96	-1,26	1,78	-0,75	-3,44	0,29	1,82
2012	19,17	2,93	4,34	4,65	-0,51	-2,76	1,10	3,08	-0,34	1,75	-0,85	2,68	1,86
2013	29,84	4,10	4,26	0,77	0,15	3,06	-2,82	4,41	-0,86	5,83	3,92	1,64	2,28
2014	7,50	-0,50	5,15	-1,60	-2,77	4,31	0,64	-2,88	2,65	-0,11	0,21	3,79	-1,23
2015	23,17	8,86	5,95	2,02	-3,70	6,13	-2,43	2,40	-2,27	0,23	2,91	2,59	-0,89
2016	9,60	-4,89	-2,35	-0,69	-1,32	0,83	-0,88	5,50	1,62	1,54	0,96	3,47	5,94
2017	21,04	1,77	2,53	3,95	2,38	4,11	-2,15	1,50	2,41	2,15	3,01	-0,54	-1,65
2018	-2,41	2,07	-3,37	-4,52	0,08	3,99	-0,07	0,85	3,83	-0,68	-1,65	-0,48	-2,11
2019	0,60	0,60											
Mittelwert	16,56	1,92	2,87	0,75	-0,06	1,40	-0,03	2,35	1,13	3,20	0,42	1,37	1,02

Einstiegsdatum	Stückzahl	Einstiegsbetrag	Ausstiegsbetrag	Gewinn/Verlust	%-Gewinn/Verlust	Transaktionskosten	Strategie	Handelsrichtung	Analysiertes Wertpapier	Umsetzungsart	Positionsgröße (%)
07.11.2018	22304	462.027,36	496.933,12	34.860,76	7,55	45,00	Mom+Makro HDAX-Aktie	LONG	TAG Immobilien AG	Direkt	2,54
28.11.2018	11315	452.034,25	466.630,60	14.551,35	3,22	45,00	Mom+Makro HDAX-Aktie	LONG	Innogy SE	Direkt	2,39
27.12.2018	6422	441.833,60	503.805,90	61.927,30	14,02	45,00	Mom+Makro HDAX-Aktie	LONG	Carl-Zeiss Meditec	Direkt	2,58
02.01.2019	19837	432.942,53	501.280,99	68.293,46	15,77	45,00	Mom+Makro HDAX-Aktie	LONG	Dialog Semiconductor plc	Direkt	2,57
23.01.2019	921	447.721,13	450.369,00	2.602,88	0,58	45,00	Mom+Makro HDAX-Aktie	LONG	Puma SE	Direkt	2,30