

# iquant MULTI-Strategie EUR V2

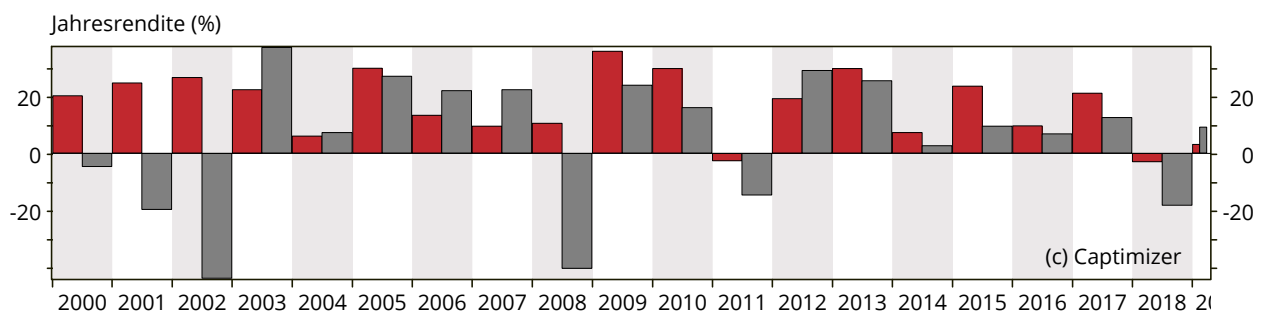
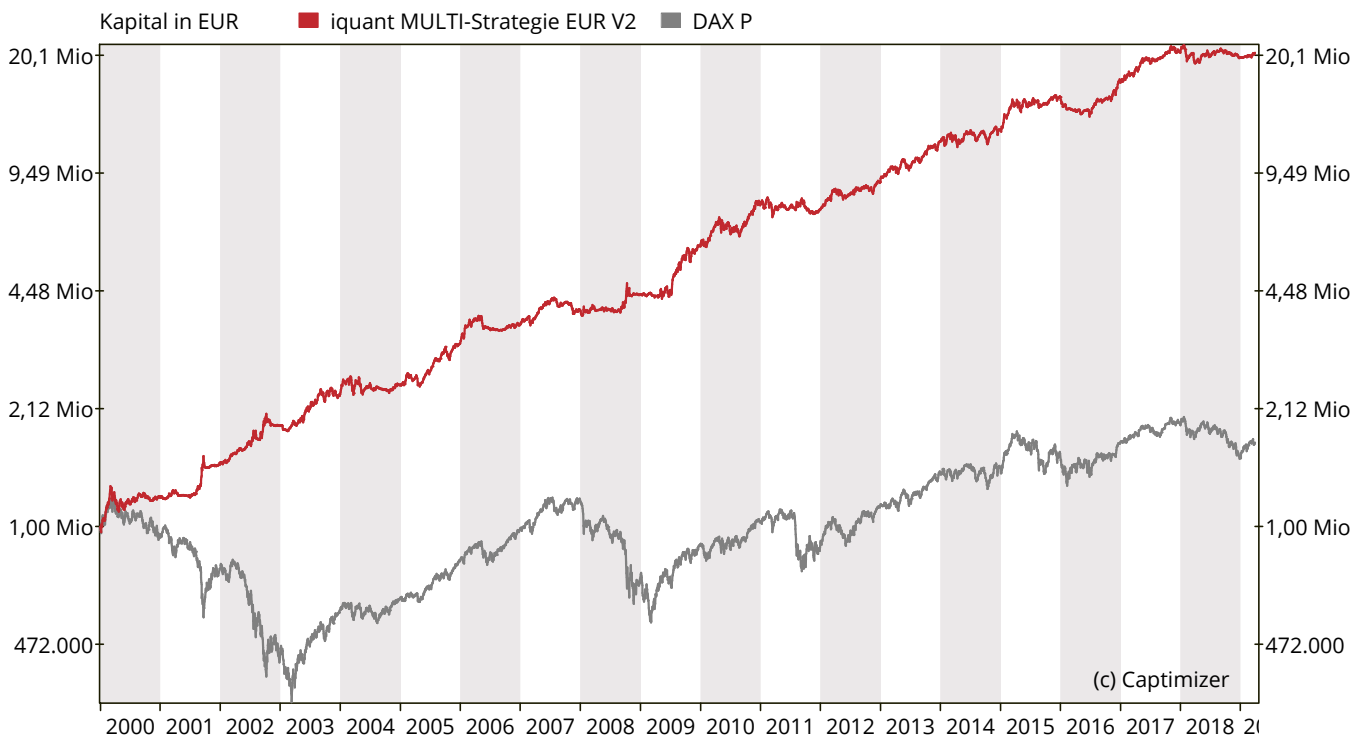
Basisdaten		
Outperformance		1.875 % (14,16 % p.a.)
Transaktionen		1308 (67,9 p.a.)
Benchmark		DAX P
	Benchmark	Strategie
Kapital		
Start 01/2000	1.000.000 EUR	1.000.000 EUR
Ende 03/2019	1.707.369 EUR	20.454.172 EUR
Rendite		
Rendite p.a. (geo.)	2,82 %	16,97 %
Rendite 2018	-18,26 %	-3,01 %
Rendite 2019 YTD	9,16 %	3,14 %
Risiko		
Maximaler Rückgang	-72,68 %	-14,92 %
Mittlerer Rückgang	-23,21 %	-4,04 %
Volatilität p.a.	20,50 %	12,07 %
Längste Verlustperiode	7,31 J.	1,47 J.
Rendite zu Risiko		
Rendite / Max. Rückgang	0,04	1,14
Rendite / Mittel Rückgang	0,12	4,20
Rendite / Volatilität p.a.	0,14	1,41

## 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.

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.	16,97 %	4,0
Outperformance p.a.	14,16 %	5,0
positive Monatsrenditen	62,77 %	4,0
Risiko		2,0
Maximaler Rückgang	-14,92 %	2,0
Mittlerer Rückgang	-4,04 %	1,5
Max. Verlustdauer	1,47 J.	1,0
Volatilität p.a.	12,07 %	2,0
Bequemlichkeit		2,5
Transaktionen p.a.	134,59	2,5
Handelstage p.a.	68,17	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	-3,00	-2,72	2,56	0,89	4,63	-0,15	-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	22,33	-2,33	1,12	2,26	1,19	6,37	2,40	5,61	4,59	-5,31	7,21	-0,83	-1,17
2004	6,10	8,20	1,13	-3,81	-0,04	-1,63	3,88	-4,45	1,14	-0,81	-0,65	1,62	1,97
2005	29,82	1,76	3,65	-0,77	-5,17	6,91	2,34	7,80	0,92	6,98	-5,14	5,91	2,25
2006	13,35	10,86	2,64	2,52	-0,35	-4,01	-1,90	-0,07	-0,20	0,83	1,59	-0,10	1,46
2007	9,56	2,72	-1,19	2,35	6,05	4,09	-0,15	2,73	-3,75	1,28	-0,24	-5,29	1,14
2008	10,48	-0,64	0,33	1,26	-0,77	0,81	-0,84	-1,22	0,26	5,36	5,06	0,85	-0,20
2009	35,78	-0,31	1,02	-2,17	1,40	1,39	0,39	12,06	4,83	7,48	-4,16	5,93	4,19
2010	29,75	0,05	4,38	8,38	2,96	-2,66	-2,89	0,32	-2,72	8,14	5,38	3,54	2,28
2011	-2,71	-1,47	3,01	-3,16	1,94	-0,23	-1,06	-1,00	1,53	-0,74	-3,44	0,29	1,82
2012	19,21	3,02	4,36	4,66	-0,36	-2,71	1,10	2,95	-0,35	1,63	-1,04	2,96	1,75
2013	29,70	4,19	4,21	0,56	0,40	3,13	-3,00	4,35	-0,90	5,85	3,93	1,64	2,29
2014	7,29	-0,50	5,16	-1,61	-2,77	4,32	0,54	-2,86	2,56	-0,19	0,21	3,83	-1,23
2015	23,51	8,88	5,99	2,02	-3,70	6,25	-2,37	2,38	-2,17	0,23	2,90	2,58	-0,89
2016	9,61	-4,89	-2,35	-0,69	-1,32	0,83	-0,88	5,50	1,62	1,55	0,96	3,48	5,93
2017	21,09	1,77	2,53	3,95	2,38	4,11	-2,15	1,53	2,41	2,15	2,98	-0,47	-1,67
2018	-3,01	1,99	-3,45	-4,52	0,07	3,87	-0,05	0,85	3,68	-0,76	-1,65	-0,51	-2,22
2019	3,14	0,56	0,38	2,19									
Mittelwert	16,82	1,91	2,77	0,83	-0,01	1,45	0,00	2,33	1,15	3,19	0,43	1,37	1,01

Einstiegsdatum	Stückzahl	Einstiegsbetrag	Ausstiegsbetrag	Gewinn/Verlust	%-Gewinn/Verlust	Transaktionskosten	Strategie	Handelsrichtung	Analysiertes Wertpapier	Umsetzungsart	Positiongröße (%)
27.12.2018	6605	451.220,58	490.091,00	38.825,42	8,60	45,00	Mom+Makro HDAX-Aktie	LONG	Carl-Zeiss Meditec	Direkt	2,40
02.01.2019	20253	442.021,73	546.831,00	104.764,27	23,70	45,00	Mom+Makro HDAX-Aktie	LONG	Dialog Semiconductor plc	Direkt	2,67
06.02.2019	3834	918.891,52	1.026.216,00	107.279,47	11,67	45,00	Mom+Trend NASDAQ100	LONG	Broadcom Inc.	Direkt	5,02
06.02.2019	11118	891.734,98	1.027.614,33	135.834,35	15,23	45,00	Mom+Trend NASDAQ100	LONG	Paypal Holdings Inc.	Direkt	5,02
06.02.2019	5485	903.201,19	898.080,41	-5.165,78	-0,57	45,00	Mom+Trend NASDAQ100	LONG	Vertex	Direkt	4,39
06.02.2019	5419	893.391,40	930.202,70	36.766,30	4,12	45,00	Mom+Trend NASDAQ100	LONG	Workday	Direkt	4,55
06.02.2019	9244	919.072,33	1.043.238,82	124.121,49	13,51	45,00	Mom+Trend NASDAQ100	LONG	Xilinx Inc. DL-,01	Direkt	5,10
15.02.2019	5968	457.327,84	442.825,60	-14.547,24	-3,18	45,00	Mom+GlobalTrend HDAX	LONG	Carl-Zeiss Meditec	Direkt	2,16
15.02.2019	17180	455.227,05	463.860,00	8.587,95	1,89	45,00	Mom+GlobalTrend HDAX	LONG	Dialog Semiconductor plc	Direkt	2,27
15.02.2019	22488	458.474,10	531.166,56	72.647,46	15,85	45,00	Mom+GlobalTrend HDAX	LONG	Evotec	Direkt	2,60
15.02.2019	2383	461.289,23	479.459,60	18.125,38	3,93	45,00	Mom+GlobalTrend HDAX	LONG	MTU Aero Engines NA	Direkt	2,34
20.02.2019	22472	464.271,52	530.788,64	66.472,12	14,32	45,00	Mom+Makro HDAX-Aktie	LONG	Evotec	Direkt	2,60
20.02.2019	2354	453.674,65	473.624,80	19.905,15	4,39	45,00	Mom+Makro HDAX-Aktie	LONG	MTU Aero Engines NA	Direkt	2,32
21.02.2019	20003	460.969,14	390.258,53	-70.755,60	-15,35	45,00	Div+Trend DAX-Aktien	LONG	Deutsche Lufthansa AG	Direkt	1,91
21.02.2019	20003	460.969,14	390.258,53	-70.755,60	-15,35	45,00	Div+Makro DAX-Aktien	LONG	Deutsche Lufthansa AG	Direkt	1,91
21.02.2019	33039	459.283,40	489.307,59	29.979,19	6,53	45,00	Div+Trend DAX-Aktien	LONG	Deutsche Telekom AG	Direkt	2,39
21.02.2019	33039	459.283,40	489.307,59	29.979,19	6,53	45,00	Div+Makro DAX-Aktien	LONG	Deutsche Telekom AG	Direkt	2,39
21.02.2019	47546	459.853,03	472.274,42	12.376,39	2,69	45,00	Div+Trend DAX-Aktien	LONG	E.ON SE	Direkt	2,31
21.02.2019	47546	459.853,03	472.274,42	12.376,39	2,69	45,00	Div+Makro DAX-Aktien	LONG	E.ON SE	Direkt	2,31
21.02.2019	3078	463.546,80	477.859,50	14.267,70	3,08	45,00	Div+Trend DAX-Aktien	LONG	Linde PLC	Direkt	2,34
21.02.2019	3078	463.546,80	477.859,50	14.267,70	3,08	45,00	Div+Makro DAX-Aktien	LONG	Linde PLC	Direkt	2,34
21.02.2019	2225	459.796,25	469.475,00	9.633,75	2,10	45,00	Div+Trend DAX-Aktien	LONG	Münchener Rück	Direkt	2,30
21.02.2019	2225	459.796,25	469.475,00	9.633,75	2,10	45,00	Div+Makro DAX-Aktien	LONG	Münchener Rück	Direkt	2,30
27.02.2019	3024	461.840,40	469.476,00	7.590,60	1,64	45,00	Mom+GlobalTrend HDAX	LONG	Linde PLC	Direkt	2,30
06.03.2019	3466	461.497,90	523.366,00	61.823,10	13,40	45,00	Mom+Makro HDAX-Aktie	LONG	Nemetschek SE O.N.	Direkt	2,56