

iquant MULTI-Strategie EUR V2

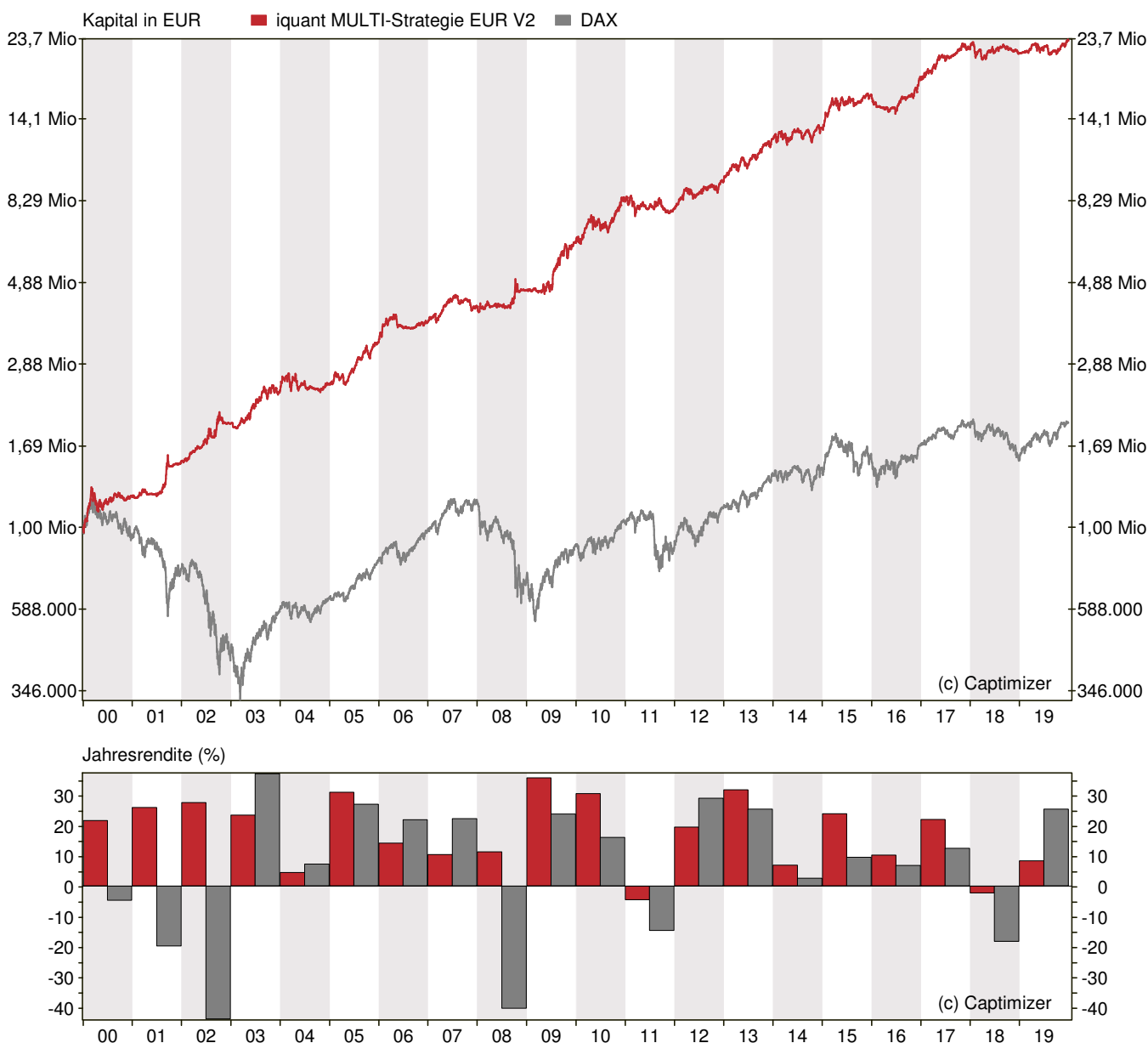
Basisdaten		
Outperformance	2.146 % (13,65 % p.a.)	
Transaktionen	1377 (68,8 p.a.)	
Benchmark	DAX	
	Benchmark	Strategie
Kapital		
Start 01/2000	1.000.000 EUR	1.000.000 EUR
Ende 12/2019	1.962.595 EUR	23.423.250 EUR
Rendite		
Rendite p.a. (geo.)	3,43 %	17,07 %
Rendite 2018	-18,26 %	-2,34 %
Rendite 2019 YTD	25,48 %	8,39 %
Risiko		
Maximaler Rückgang	-72,68 %	-14,71 %
Mittlerer Rückgang	-22,67 %	-3,92 %
Volatilität p.a.	20,28 %	12,02 %
Längste Verlustperiode	7,31 J.	1,90 J.
Rendite zu Risiko		
Rendite / Max. Rückgang	0,05	1,16
Rendite / Mittel Rückgang	0,15	4,35
Rendite / Volatilität p.a.	0,17	1,42

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.

Bei der Simulation der Anlageergebnisse wurden Transaktionskosten von 0,1% je Kauf und je Verkauf berücksichtigt. Die Gebühren der Ziel-ETFs würden mit den aktuellen Werten ebenfalls in der Berechnung berücksichtigt. Die Liquidität wird im Geldmarkt zum Eonia-Geldmarktsatz angelegt.



iquant MULTI-Strategie EUR V2

	Jahresrenditen (%)	Monatsrenditen (%)											
		Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez
2000	21,65	3,98	18,46	-2,02	-2,87	-2,63	2,67	1,00	4,73	-0,07	-3,78	2,47	-0,41
2001	26,01	-0,86	2,61	1,77	-1,90	0,14	-0,93	1,53	6,16	12,45	0,56	0,58	2,01
2002	27,63	1,54	1,60	3,70	2,98	-0,49	3,16	5,45	-2,40	14,78	-2,38	-2,28	0,14
2003	23,51	-2,27	1,20	2,34	1,26	6,45	2,48	5,73	4,65	-5,23	7,30	-0,75	-1,08
2004	4,54	8,27	1,20	-3,71	0,08	-2,14	3,26	-4,98	0,65	-0,72	-0,59	1,70	2,06
2005	30,99	1,83	3,73	-0,63	-5,08	6,96	2,44	7,84	0,96	7,04	-5,06	5,95	2,34
2006	14,23	10,88	2,70	2,59	-0,29	-3,94	-1,86	0,00	-0,12	0,90	1,68	-0,04	1,55
2007	10,46	2,80	-1,11	2,42	6,14	4,14	-0,06	2,82	-3,72	1,33	-0,16	-5,26	1,21
2008	11,37	-0,60	0,42	1,37	-0,70	0,85	-0,78	-1,12	0,33	5,45	5,08	0,90	-0,12
2009	35,77	-0,23	1,11	-2,11	1,43	1,48	0,57	12,17	4,65	7,47	-4,52	6,63	3,41
2010	30,58	-0,15	4,33	8,57	2,66	-2,17	-2,79	0,37	-2,64	8,20	5,43	3,63	2,36
2011	-4,53	-1,42	1,26	-3,30	2,02	-0,78	-0,86	-0,93	1,52	-0,73	-3,41	0,32	1,88
2012	19,52	3,07	4,40	4,75	-0,26	-2,94	1,19	3,00	-0,28	1,71	-1,02	3,07	1,57
2013	31,86	4,58	4,70	0,97	0,48	2,54	-2,63	5,07	-1,13	5,72	4,04	2,31	1,69
2014	6,91	-0,28	4,65	-1,78	-2,70	4,43	0,58	-2,82	1,97	-0,31	0,62	3,88	-1,15
2015	23,96	8,90	6,03	2,11	-3,62	6,36	-2,72	2,48	-2,14	0,30	2,97	2,65	-0,83
2016	10,30	-4,85	-2,27	-0,63	-1,31	0,86	-0,85	5,57	1,71	1,61	1,05	3,49	6,00
2017	22,04	1,86	2,60	3,99	2,44	4,16	-2,07	1,60	2,46	2,22	3,03	-0,41	-1,58
2018	-2,34	2,08	-3,42	-4,52	0,17	3,94	0,02	0,92	3,79	-0,72	-1,66	-0,46	-2,14
2019	8,39	0,62	0,38	2,31	3,11	-5,11	1,28	0,19	-2,09	1,18	0,86	3,13	2,51
Mittelwert	17,64	1,99	2,73	0,91	0,20	1,11	0,11	2,29	0,95	3,13	0,50	1,58	1,07