

iquant MULTI-Strategie EUR V2

Basisdaten		
Outperformance	2.747 % (13,14 % p.a.)	
Transaktionen	1509 (70,2 p.a.)	
Benchmark	DAX P	
	Benchmark	Strategie
Kapital		
Start 01/2000	1.000.000 EUR	1.000.000 EUR
Ende 06/2021	2.300.636 EUR	29.773.108 EUR
Rendite		
Rendite p.a. (geo.)	3,95 %	17,09 %
Rendite 2020	3,55 %	14,06 %
Rendite 2021 YTD	13,21 %	11,23 %
Risiko		
Maximaler Rückgang	-72,68 %	-15,43 %
Mittlerer Rückgang	-21,59 %	-3,97 %
Volatilität p.a.	20,66 %	11,89 %
Längste Verlustperiode	7,31 J.	1,82 J.
Rendite zu Risiko		
Rendite / Max. Rückgang	0,05	1,11
Rendite / Mittel Rückgang	0,18	4,30
Rendite / Volatilität p.a.	0,19	1,44

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.

