

iquant MULTI-Strategie EUR V2

Basisdaten			Beschreibung
Outperformance	3.199 % (14,12 % p.a.)		
Transaktionen	1585 (69,6 p.a.)		
Benchmark	DAX P		
	Benchmark	Strategie	
Kapital			
Start 01/2000	1.000.000 EUR	1.000.000 EUR	
Ende 09/2022	1.794.518 EUR	33.781.983 EUR	
Rendite			
Rendite p.a. (geo.)	2,60 %	16,72 %	
Rendite 2021	15,79 %	16,55 %	
Rendite 2022 YTD	-23,74 %	-9,64 %	
Risiko			
Maximaler Rückgang	-72,68 %	-15,31 %	
Mittlerer Rückgang	-20,91 %	-3,82 %	
Volatilität p.a.	20,47 %	11,66 %	
Längste Verlustperiode	7,31 J.	1,46 J.	
Rendite zu Risiko			
Rendite / Max. Rückgang	0,04	1,09	
Rendite / Mittel Rückgang	0,12	4,37	
Rendite / Volatilität p.a.	0,13	1,43	

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.

