



Backtestergebnisse Investmentstrategien

nur zur privaten Nutzung

**Weitergabe und Weiterverbreitung nur mit
ausdrücklicher Zustimmung seitens investolio**

Stand: 03.06.2022

Einführung: Erklärung der Analysemethoden

Auf den folgenden Seiten erhalten Sie eine kurze Erklärung wie die Backtests der Investmentstrategien aufgebaut sind und was die einzelnen Analysen aussagen. Natürlich können Sie aber auch ohne diese Einführung zu lesen direkt zu den ausführlichen Backtestergebnissen springen. Die Erklärungen hier sind bewusst etwas knapper gehalten. Eine ausführliche Erläuterung über unsere Vorgehensweise beim Backtesting sowie die Auswertung der Ergebnisse erhalten Sie in unseren Videokursen. Die Videokurse sind Teil des investolio-Premium-Bereichs.

Folgende Videokurse sind hierfür von besonderer Relevanz:

- Videokurs „Backtests“ (als Einführung in das Thema Backtesting)
- Videokurs „Backtestmethodik“ (insb. das Video „Drei Ergebnisse der Backtests“)
- Videokurs „Anwendung der Scoring-Modelle“ (die beiden Videos „Ein beispielhaftes Backtestergebnis“)

Was hat es mit den Investmentstrategien auf sich?

In diesem Dokument finden Sie die detaillierten Backtestergebnisse der Investmentstrategien, wie sie im investolio-Premium bei uns angeboten werden. Jede Investmentstrategie wird auf Basis unserer Scoring-Modelle konstruiert und verfolgt ein 100% klar definiertes Regelwerk. Für ausführliche Backtestergebnisse zu den einzelnen Scoring-Modellen verweisen wir an dieser Stelle auf die jeweiligen PDFs, die Sie ebenfalls auf unserer Homepage downloaden können. Folgen Sie hierfür bitte folgendem Link: <https://www.investolio.de/de/hilfe/backtests>

Hier soll es ausschließlich um die Backtests zu den Investmentstrategien gehen, die Sie exakt so im Mitgliederbereich von investolio-Premium vorfinden. Diese Strategien verfolgen vor allem zwei Ziele. Zum einen wollen wir Ihnen damit einen einfachen Einstieg in die Welt der Scoring-Modelle ermöglichen. Sie können bspw. eine oder mehrere der Investmentstrategien eins zu eins kopieren und für sich selbst umsetzen. Zum anderen dienen die Investmentstrategien aber auch als Performancenachweis. Die Strategien laufen inzwischen mehrere Jahre und zeigen, dass Strategien auf Basis unserer Scoring-Modelle nicht nur in Backtests, sondern auch in der praktischen Umsetzung Live an der Börse funktionieren.

Ein Großteil der Investmentstrategien wird von uns übrigens mit echtem Geld umgesetzt. Ob eine der Investmentstrategien mit echtem Geld umgesetzt wird können Sie der Beschreibung der Strategie in diesem Dokument entnehmen.

Außerdem finden Sie dort jeweils eine kurze Erläuterung wie genau das Regelwerk der Strategie aussieht und für welche Art von Investor die Strategie geeignet ist.

Aufbau der Backtests der Investmentstrategien

Vorstellung der Strategie

Zu Beginn einer jeden Strategie im **Abschnitt „Vorstellung der Strategie“** finden Sie zunächst eine kurze Beschreibung nach welchem Regelwerk die Strategie investiert und für welchen Investor sie geeignet ist.

Backtestergebnisse

Im nächsten Abschnitt folgen die eigentlichen **Backtestergebnisse**. In der ersten Tabelle finden Sie folgende Informationen:

Übersicht Performancemaße: An dieser Stelle werten wir die wichtigsten Performancemaße aus. Hierzu gehören: die annualisierte Rendite, die Volatilität, der Maximale Drawdown sowie das Rendite-Risiko-Verhältnis. Das Rendite-Risiko-Verhältnis ergibt sich, indem die Rendite durch die Volatilität dividiert wird. Um eine Investmentstrategie zu beurteilen betrachten wir in erster Linie diese vier Kennzahlen.

Für die Rendite sowie das Rendite-Risiko-Verhältnis gilt, dass hohe Werte besser sind als niedrige. Bei der Volatilität und dem Maximalen Drawdown werden hingegen niedrige Werte bevorzugt.

Diese Daten finden Sie im linken Teil der ersten Tabelle einer Investmentstrategie.

Strategiespezifikationen: Die Strategiespezifikationen geben Auskunft über die wichtigsten Eigenschaften der Investmentstrategie. Das betrifft die Anzahl der im Depot enthaltenen Aktien, die Verkaufskriterien (bei Unterschreitung welcher Score-Grenzen wird eine Aktie verkauft) sowie den Depotumschlagsfaktor. Der Depotumschlagsfaktor ist ein Maß dafür wie häufig einzelne Aktien gekauft und verkauft werden. Ein Depotumschlagsfaktor von 2 sagt bspw. aus, dass eine einzelne Position im Depot im Jahr 2 Mal wechselt. Andersherum lässt sich sagen, dass die durchschnittliche Haltedauer einer Aktie 6 Monate beträgt ($= 12 \text{ Monate} / 2$).

Diese Daten finden Sie im rechten Teil der ersten Tabelle einer Investmentstrategie.

Im Chart unter der ersten Tabelle sehen Sie die Wertentwicklung ausgehend von einem Investment von 1.000€ im Zeitverlauf dargestellt. Beachten Sie bitte, dass hierbei keine Transaktionskosten & Steuern berücksichtigt sind und davon ausgegangen wird, dass Aktien beim Kauf und Verkauf beliebig teilbar sind.

In den weiteren beiden Tabellen ist die Entwicklung der Investmentstrategie über einzelne Jahre dargestellt. In der ersten Tabelle betrachten wir einzelne 5-Jahres-Zeiträume. Hier werten wir die jährliche Rendite, die Volatilität und den maximalen Drawdown in einzelnen kleineren Zeiträumen aus, um ein noch besseres Gefühl dafür zu bekommen, wie sich die jeweilige Investmentstrategie insb. auch im Vergleich zur Benchmark über die Zeit entwickelt.

In der zweiten Tabelle vergleichen wir für jedes Jahr die Rendite unserer Strategie mit der Rendite unseres Vergleichsindex. Welcher Vergleichsindex für die Strategie herangezogen wird ist zu Beginn der Vorstellung der Investmentstrategie erläutert. Diese Tabelle enthält also nicht einfach die jährlichen Renditen, sondern die jährliche Outperformance (bzw. Überrendite) der Strategie.

Depot seit Auflage am ...

Im letzten Abschnitt zu jeder Investmentstrategie werten wir noch aus, wie sich die Strategie seit Beginn der realen Umsetzung entwickelt hat. Diese Auswertungen finden Sie im **Abschnitt „Depot seit Auflage am...“**. Wir vergleichen hier die Rendite seit Auflage der Strategie, die Volatilität und den Maximalen Drawdown jeweils mit einem fairen Vergleichsindex. Welcher Vergleichsindex verwendet wird ist zu Beginn der Vorstellung der Investmentstrategie angegeben. Außerdem wird die Wertentwicklung der Investmentstrategie im Vergleich zur jeweiligen Benchmark im Chart dargestellt.

Wie eingangs bereits erwähnt wird ein Großteil der vorgestellten Investmentstrategien von uns mit echtem Geld umgesetzt. Die in diesem Abschnitt vorgenommenen Auswertungen sind der ideale Performancenaachweis, dass die Investmentstrategien (und damit die Aktienausswahl auf Basis der Scoring-Modelle) nicht nur in Backtests gute Ergebnisse generiert, sondern auch im Live-Betrieb an der Börse funktioniert.

Abgrenzung „Depot“ & „Depot IQ“

In den Ergebnissen der Investmentstrategien sehen Sie jeweils 3 Spalten (Depot, Depot IQ und Benchmark). Die Spalte Depot gibt die Performancemaße für die analysierte Investmentstrategie ohne Anwendung unserer Investitionsquote an (das bedeutet die Strategie ist unabhängig von der Marktlage immer zu 100% investiert). Die Spalte Depot IQ zeigt die Ergebnisse der analysierten Investmentstrategie unter Berücksichtigung unserer variablen Investitionsquote an. Abhängig von der aktuellen Marktlage ist hier eine Cashposition von bis zu 50% möglich. In der Spalte Benchmark sind abschließend die Performancemaße für den verwendeten Vergleichsindex aufgelistet.

Der Beschreibung der jeweiligen Strategie können Sie entnehmen, ob die vorgestellte Investmentstrategie von uns mit oder ohne Anwendung unserer Investitionsquote umgesetzt wird.

Wieso stellen wir Ihnen unabhängig davon aber sowohl die Ergebnisse mit als auch ohne Anwendung unserer Investitionsquote vor? So bekommen Sie für sich selbst ein besseres Bild, ob es für Sie sinnvoll ist die Investitionsquote anzuwenden oder nicht. Die Anwendung der Investitionsquote ist sinnvoll, wenn Sie größere Kurseinbrüche etwas abfedern wollen. In der Regel geht das allerdings ein wenig auf Kosten der Rendite.

Wenn Sie eine unserer Investmentstrategien eins zu eins kopieren wollen, ist dies bei den meisten Strategien nur mit Anwendung unserer Investitionsquote möglich. Sie können sich allerdings auch Ihre eigene Strategie individuell definieren und dafür an den Regelwerken der hier vorgestellten Investmentstrategien orientieren.

Deutschland Trend mit Safety

Vorstellung der Strategie

Die Strategie Deutschland Trend mit Safety investiert in die 10 besten Aktien aus dem CDAX gemessen am Trend-Score. Damit eine Aktie für einen Kauf infrage kommt muss der Safety-Score außerdem über 50% liegen.

Verkauft wird eine Aktie, wenn ihr Trend-Score unter 60% oder ihr Safety-Score unter 40% fällt. In diesem Fall wird die nächstbeste Aktie aus der Rangliste nach dem Trend-Score nachgekauft, wobei der Safety-Score größer sein muss als 50%.

Zusätzlich wird bei dieser Strategie unsere variable Investitionsquote berücksichtigt. Abhängig von der aktuellen Investitionsquote können auch weniger als die 10 vorgesehen Aktien im Depot vertreten sein. Die Depotzusammensetzung wird einmal wöchentlich überprüft.

Die Benchmark dieses Depot ist der CDAX.

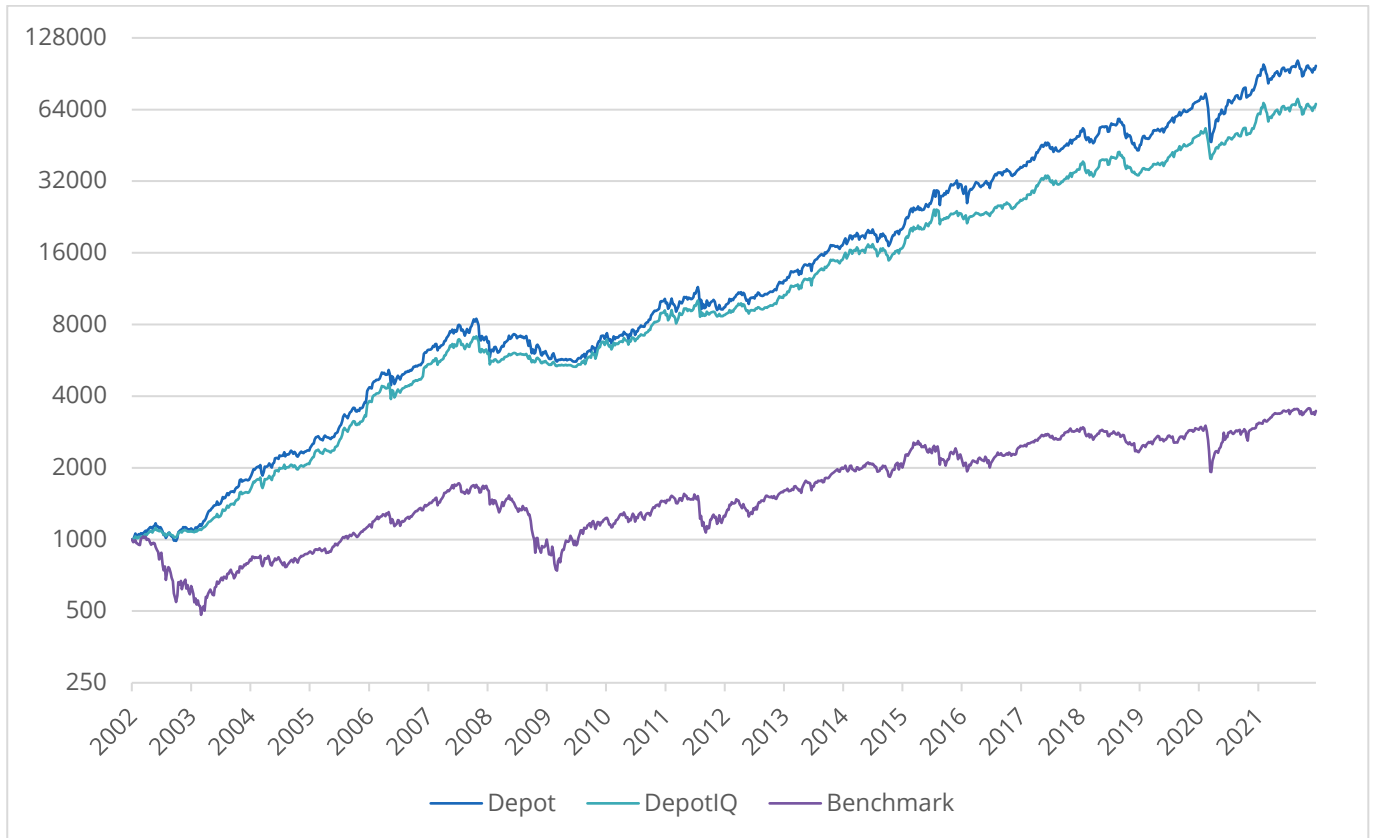
Echtgeld-Depot: Dieses Depot bilden wir 1:1 mit unserem eigenen Geld nach.

Die Depotzusammensetzung sowie die aktuellsten Trades finden Sie eins zu eins auf der Seite der Investmentstrategie im investolio-Premium-Bereich.

Diese Strategie eignet sich für Investoren, die in deutsche Aktien investieren wollen und die mit größeren Schwankungen leben können. Die Strategie investiert gezielt in Aktien, die bereits einen starken Aufwärtstrend aufweisen. Gerade kurzfristig neigen diese Aktien allerdings zu größeren Schwankungen. Langfristig ist diese Strategie dafür aber in der Lage eine deutliche Outperformance zum Gesamtmarkt zu erzielen. Besonders in Phasen in denen am Aktienmarkt starke Trends vorliegen performt diese Strategie besonders gut.

Backtestergebnisse

	Depot	Depot IQ	Benchmark		
Annualisierte Rendite	25,7%	23,4%	6,4%	Anzahl Aktien im Depot	10
Annualisierte Volatilität	20,7%	17,1%	22,2%	Verkaufskriterium 1	Trend 60%
Maximaler Drawdown	37,4%	25,6%	57,0%	Verkaufskriterium 2	Safety 40%
Rendite-Risiko-Verhältnis	1,239	1,367	0,288	Depotumschlagsfaktor	1,57



Zeitraum	Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002 bis 27.12.2004	33,6%	27,9%	-4,4%	14,8%	12,2%	28,7%	15,6%	9,8%	53,1%
27.12.2004 bis 28.12.2009	23,9%	25,7%	6,8%	21,1%	17,7%	23,5%	34,1%	25,6%	57,0%
28.12.2009 bis 29.12.2014	23,4%	20,4%	11,3%	20,2%	17,1%	19,5%	20,0%	14,8%	31,2%
29.12.2014 bis 30.12.2019	28,1%	24,4%	6,8%	20,5%	17,1%	17,4%	26,3%	20,3%	25,5%
30.12.2019 bis 27.12.2021	18,6%	16,6%	9,2%	28,2%	21,7%	25,1%	37,4%	25,6%	36,2%

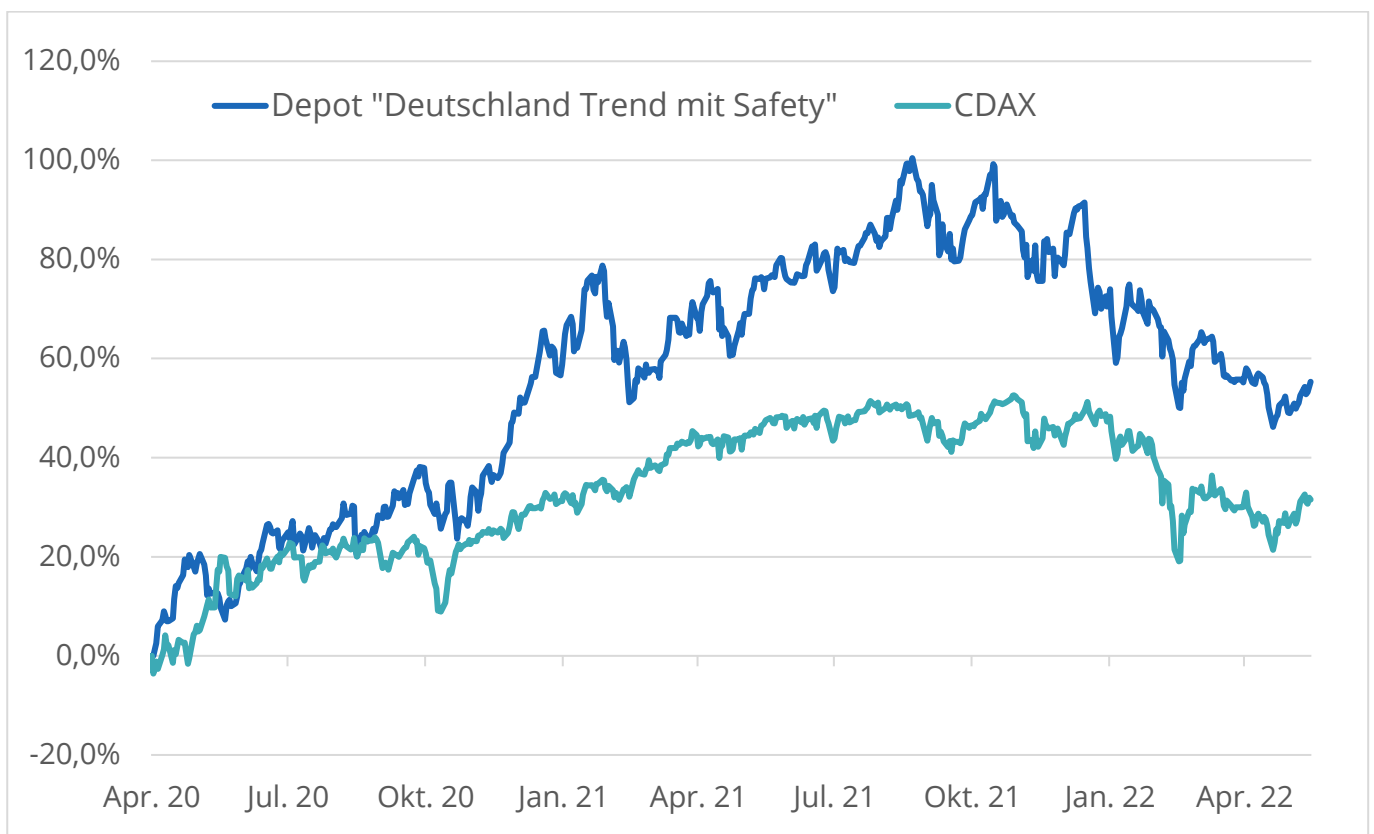
Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Depot IQ vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	51,0%	49,0%
30.12.2002	bis	29.12.2003	24,9%	9,2%
29.12.2003	bis	27.12.2004	24,9%	23,6%
27.12.2004	bis	26.12.2005	48,5%	48,2%
26.12.2005	bis	25.12.2006	22,7%	21,5%
25.12.2006	bis	31.12.2007	-5,3%	-3,6%
31.12.2007	bis	29.12.2008	30,8%	33,3%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-16,5%	-12,2%
28.12.2009	bis	27.12.2010	26,2%	18,7%
27.12.2010	bis	26.12.2011	7,6%	12,0%
26.12.2011	bis	31.12.2012	-1,2%	-10,4%
31.12.2012	bis	30.12.2013	17,2%	17,2%
30.12.2013	bis	29.12.2014	12,5%	7,2%
29.12.2014	bis	28.12.2015	45,9%	31,8%
28.12.2015	bis	26.12.2016	8,6%	4,3%
26.12.2016	bis	25.12.2017	19,9%	19,9%
25.12.2017	bis	31.12.2018	6,4%	13,4%
31.12.2018	bis	30.12.2019	35,9%	21,6%
30.12.2019	bis	28.12.2020	18,6%	14,4%
28.12.2020	bis	27.12.2021	0,3%	0,3%

Depot seit Auflage am 20.04.2020

Das Depot „Deutschland Trend mit Safety“ setzen wir mit echtem Geld um. Gestartet ist das Depot am 20.04.2020 mit einem Kapital von 100.000€. Die Performance seitdem ist der folgenden Tabelle und dem Chart zu entnehmen. Transaktionskosten sind in der Auswertung bereits berücksichtigt, Steuern allerdings nicht.

Stand: 03.06.2022

	Depot "Deutschland Trend mit Safety"	CDAX
Rendite seit Auflage	+55,3%	+31,5%
Volatilität	24,8%	19,9%
Maximaler Drawdown	-27,1%	-22,0%



Deutschland Trend mit Value

Vorstellung der Strategie

Die Strategie Deutschland Trend mit Value investiert in die 10 besten Aktien aus dem CDAX gemessen am Trend-Score. Damit eine Aktie für einen Kauf infrage kommt muss der Value-Score außerdem über 50% liegen.

Verkauft wird eine Aktie, wenn ihr Trend-Score unter 60% oder ihr Value-Score unter 40% fällt. In diesem Fall wird die nächstbeste Aktie aus der Rangliste nach dem Trend-Score gekauft, wobei der Value-Score größer sein muss als 50%.

Zusätzlich wird bei dieser Strategie unsere variable Investitionsquote berücksichtigt. Abhängig von der aktuellen Investitionsquote können auch weniger als die 10 vorgesehenen Aktien im Depot enthalten sein. Die Depotzusammensetzung wird einmal wöchentlich überprüft.

Benchmark dieses Depots ist der CDAX.

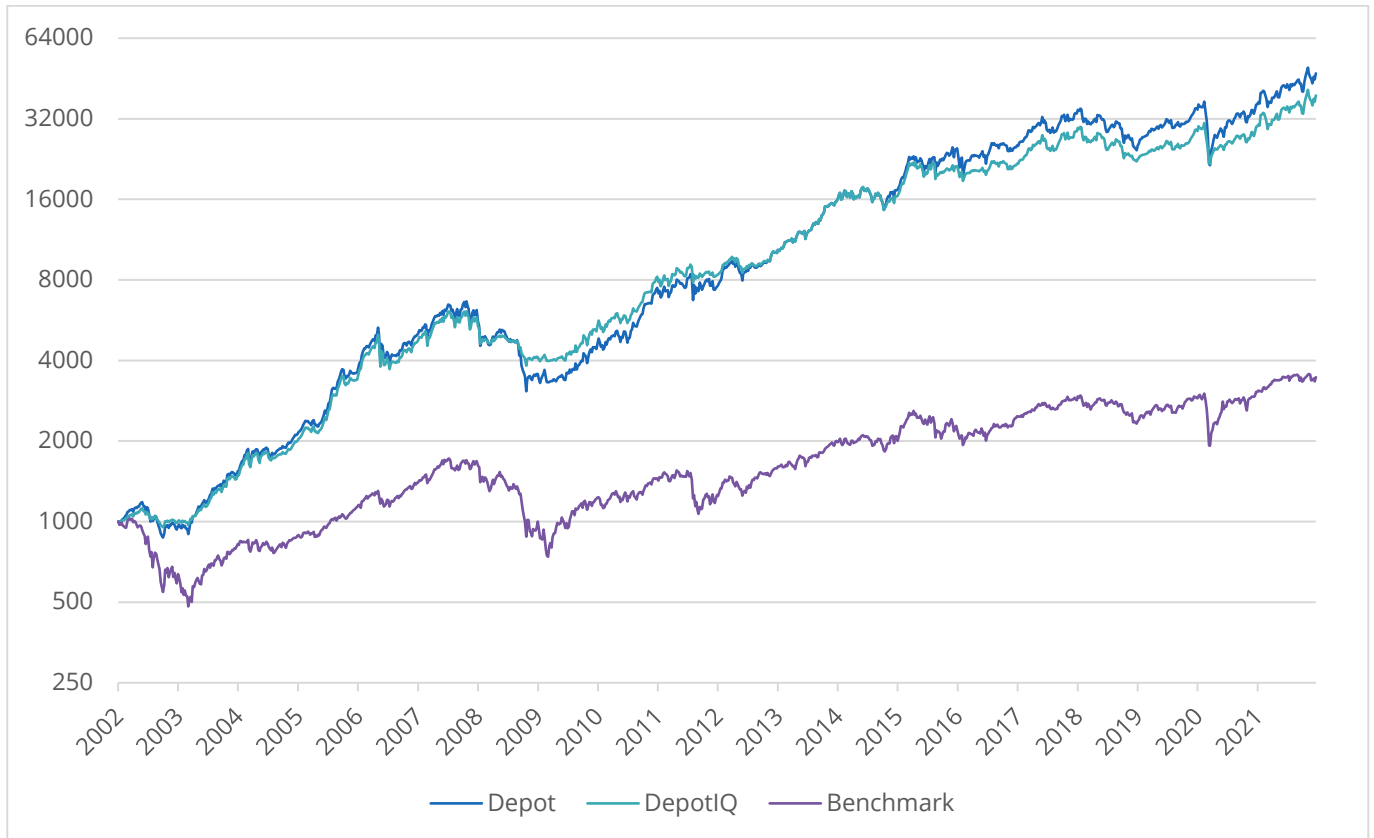
Bei diesem Depot handelt es sich um ein reines Musterdepot.

Die Depotzusammensetzung sowie die aktuellsten Trades finden Sie eins zu eins auf der Seite der Investmentstrategie im investolio-Premium-Bereich.

Diese Strategie eignet sich für Investoren, die in deutsche Aktien investieren wollen und auf der Suche nach Trendaktien sind, allerdings gleichzeitig auf eine moderate Bewertung achten. Die Strategie investiert gezielt in Aktien, die bereits einen starken Aufwärtstrend aufweisen. Gerade kurzfristig neigen diese Aktien allerdings zu größeren Schwankungen. Langfristig ist diese Strategie dafür aber in der Lage eine deutliche Outperformance zum Gesamtmarkt zu erzielen. Durch die zusätzliche Betrachtung der Bewertung ist sichergestellt, dass das Depot zwar aus trendstarken Aktien besteht, aber immer eine solide fundamentale Basis vorhanden ist.

Backtestergebnisse

	Depot	Depot IQ	Benchmark		
Annualisierte Rendite	21,2%	20,1%	6,4%	Anzahl Aktien im Depot	10
Annualisierte Volatilität	24,4%	20,1%	22,2%	Verkaufskriterium 1	Trend 60%
Maximaler Drawdown	53,9%	37,5%	57,0%	Verkaufskriterium 2	Value 40%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,868	0,999	0,288	Depotumschlagsfaktor	1,66



Zeitraum	Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002 bis 27.12.2004	28,4%	25,9%	-4,4%	18,5%	14,8%	28,7%	26,4%	15,0%	53,1%
27.12.2004 bis 28.12.2009	15,9%	20,9%	6,8%	27,6%	23,4%	23,5%	53,9%	37,5%	57,0%
28.12.2009 bis 29.12.2014	31,3%	26,0%	11,3%	23,2%	19,3%	19,5%	20,0%	17,9%	31,2%
29.12.2014 bis 30.12.2019	15,1%	12,1%	6,8%	22,1%	18,1%	17,4%	30,0%	25,7%	25,5%
30.12.2019 bis 27.12.2021	16,1%	15,8%	9,2%	31,8%	24,5%	25,1%	42,3%	29,6%	36,2%

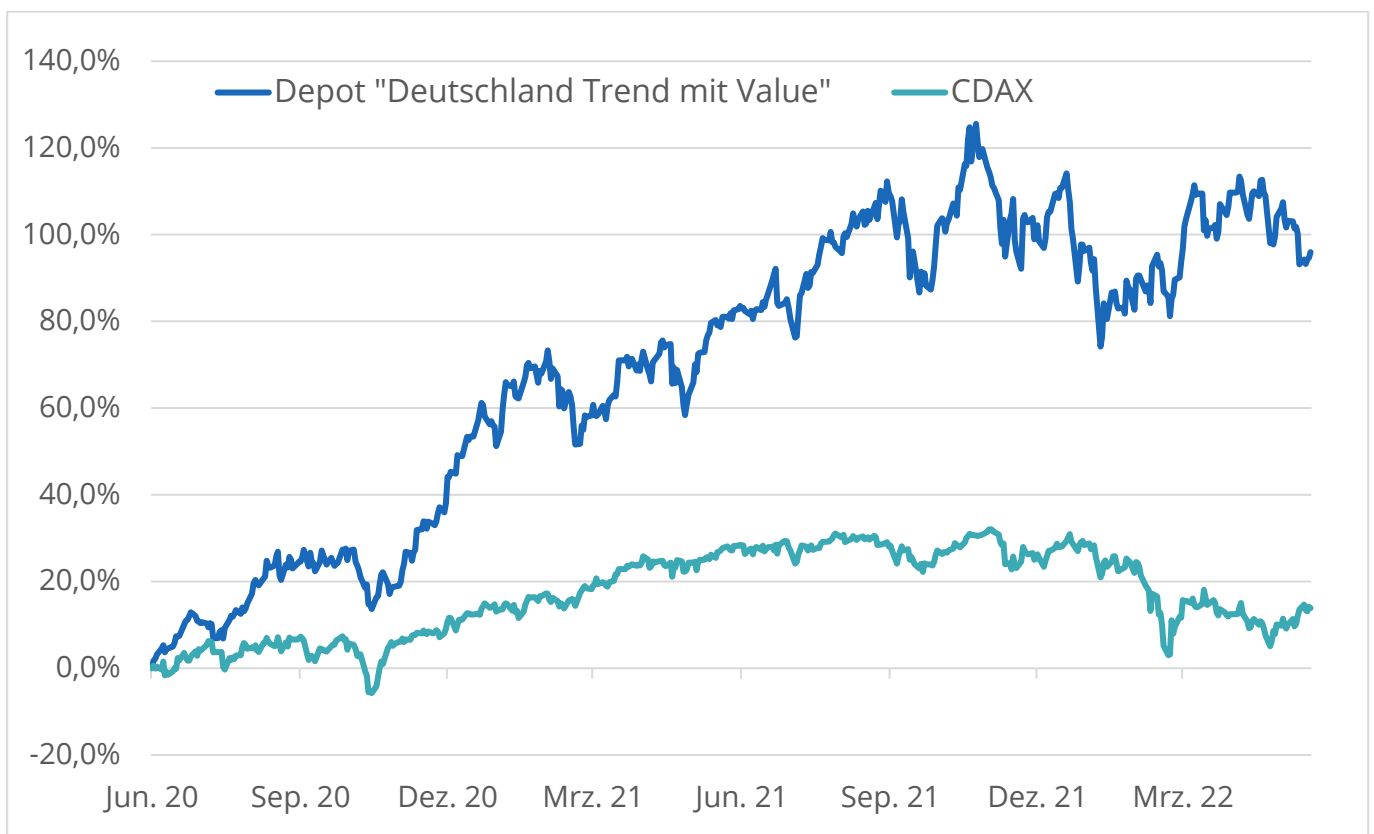
Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Depot IQ vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	34,6%	40,0%
30.12.2002	bis	29.12.2003	23,1%	9,2%
29.12.2003	bis	27.12.2004	32,3%	29,1%
27.12.2004	bis	26.12.2005	41,8%	41,4%
26.12.2005	bis	25.12.2006	15,0%	15,1%
25.12.2006	bis	31.12.2007	3,2%	2,6%
31.12.2007	bis	29.12.2008	1,5%	15,0%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-5,0%	-4,3%
28.12.2009	bis	27.12.2010	48,7%	39,6%
27.12.2010	bis	26.12.2011	16,5%	17,3%
26.12.2011	bis	31.12.2012	5,9%	-7,7%
31.12.2012	bis	30.12.2013	29,0%	29,0%
30.12.2013	bis	29.12.2014	5,8%	0,2%
29.12.2014	bis	28.12.2015	32,3%	19,9%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-4,8%	-6,0%
26.12.2016	bis	25.12.2017	16,8%	16,8%
25.12.2017	bis	31.12.2018	-8,5%	-4,0%
31.12.2018	bis	30.12.2019	18,5%	6,2%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-2,0%	-2,6%
28.12.2020	bis	27.12.2021	17,5%	17,5%

Depot seit Auflage am 16.06.2020

Das Depot „Deutschland Trend mit Value“ wird nur als Musterdepot geführt. Gestartet ist das Depot am 16.06.2020 mit einem virtuellen Kapital von 50.000€. Die Performance seitdem ist der folgenden Tabelle und dem Chart zu entnehmen. Transaktionskosten sind in der Auswertung bereits berücksichtigt, Steuern allerdings nicht.

Stand: 03.06.2022

	Depot "Deutschland Trend mit Value"	CDAX
Rendite seit Auflage	+95,9%	+13,8%
Volatilität	26,2%	18,5%
Maximaler Drawdown	-22,8%	-22,0%



Deutschland & USA Trend

Vorstellung der Strategie

Die Strategie Deutschland und USA Trend investiert in insgesamt 15 Aktien mit dem höchsten Trend-Score. 8 Aktien werden aus dem CDAX ausgewählt, 7 weitere aus dem Nasdaq100.

Verkauft wird eine Aktie, wenn ihr Trend-Score unter 70% fällt. In diesem Fall wird die nächstbeste Aktie aus der Rangliste nach dem Trend-Score nachgekauft.

Zusätzlich wird bei dieser Strategie unsere variable Investitionsquote berücksichtigt. Abhängig von der aktuellen Investitionsquote können auch weniger als die 15 vorgesehenen Aktien im Depot enthalten sein. Die Depotzusammensetzung wird einmal wöchentlich überprüft.

Die Benchmark entspricht der gewichteten Performance aus dem CDAX und dem Nasdaq100.

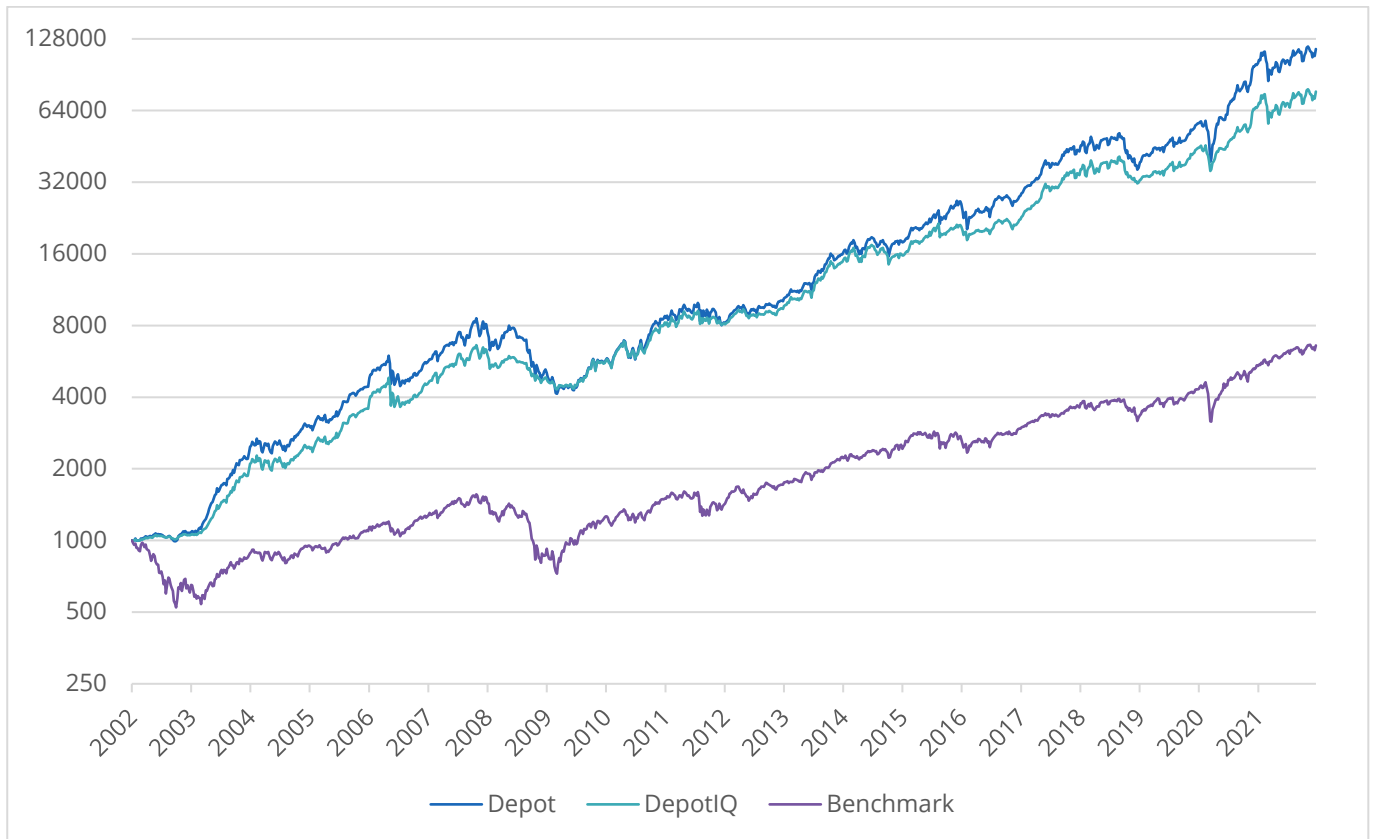
Echtgeld-Depot: Dieses Depot bilden wir 1:1 mit unserem eigenen Geld nach.

Die Depotzusammensetzung sowie die aktuellsten Trades finden Sie eins zu eins auf der Seite der Investmentstrategie im investolio-Premium-Bereich.

Diese Strategie ist unsere offensivste Strategie bei investolio. Da wir hier ausschließlich auf den Trend-Score schauen, wird in der Regel in Aktien investiert, die bereits starke Aufwärtstrends hinter sich haben. Solche Aktien tendieren vor allem kurzfristig zu großen Schwankungen. Da kein Filter hinsichtlich der Kursschwankungen einer Aktie oder ihrer fundamentalen Bewertung vorhanden ist, befinden sich auch äußerst risikoreiche Aktien im Depot. Diese Strategie eignet sich daher nur für Investoren, denen das erhöhte Risiko bewusst ist. Langfristig ist die Strategie dafür in der Lage eine deutliche Outperformance zum Gesamtmarkt zu erzielen.

Backtestergebnisse

	Depot	Depot IQ	Benchmark			
Annualisierte Rendite	26,8%	24,2%	9,9%	Anzahl Aktien im Depot 15		
Annualisierte Volatilität	24,8%	20,6%	20,7%	Verkaufskriterium	Trend	70%
Maximaler Drawdown	52,0%	34,8%	53,6%	Depotumschlagsfaktor 1,64		
Rendite-Risiko-Verhältnis	1,080	1,172	0,476			



Zeitraum	Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002 bis 27.12.2004	45,3%	35,5%	-1,8%	17,4%	16,1%	27,0%	13,3%	13,3%	47,7%
27.12.2004 bis 28.12.2009	12,9%	17,5%	5,7%	26,9%	22,3%	22,6%	52,0%	34,8%	53,6%
28.12.2009 bis 29.12.2014	26,4%	23,4%	15,0%	23,7%	19,2%	17,4%	19,6%	17,0%	20,8%
29.12.2014 bis 30.12.2019	25,4%	22,7%	11,3%	22,2%	18,5%	16,2%	29,9%	23,0%	19,2%
30.12.2019 bis 27.12.2021	43,3%	31,2%	23,7%	35,4%	29,4%	23,2%	32,8%	24,8%	31,5%

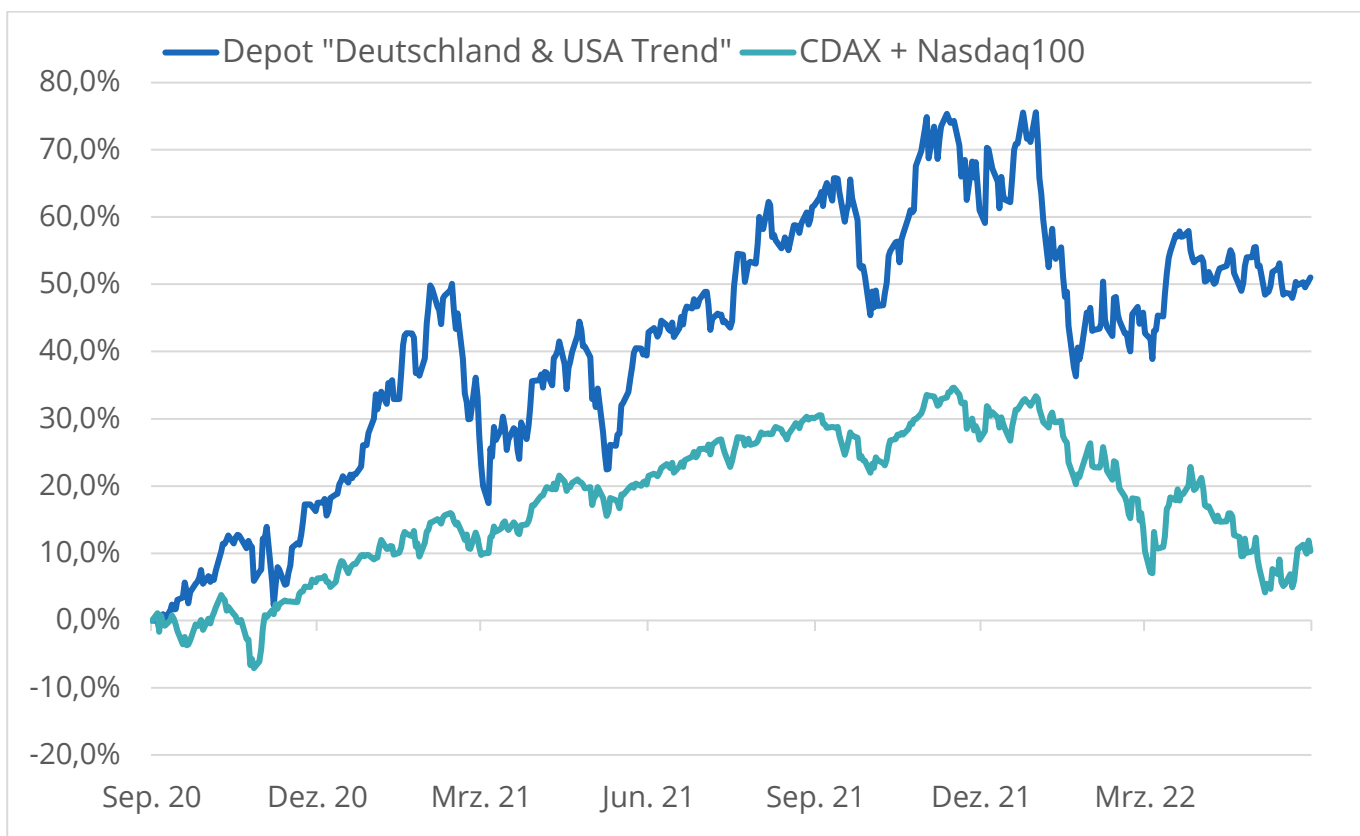
Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Depot IQ vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	46,9%	44,8%
30.12.2002	bis	29.12.2003	75,2%	45,4%
29.12.2003	bis	27.12.2004	20,4%	14,9%
27.12.2004	bis	26.12.2005	29,1%	28,4%
26.12.2005	bis	25.12.2006	12,2%	12,7%
25.12.2006	bis	31.12.2007	24,7%	19,6%
31.12.2007	bis	29.12.2008	7,4%	19,2%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-37,4%	-29,9%
28.12.2009	bis	27.12.2010	33,5%	25,2%
27.12.2010	bis	26.12.2011	1,7%	7,7%
26.12.2011	bis	31.12.2012	1,2%	-7,4%
31.12.2012	bis	30.12.2013	26,6%	26,6%
30.12.2013	bis	29.12.2014	1,7%	-4,3%
29.12.2014	bis	28.12.2015	37,6%	23,6%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-2,6%	-2,4%
26.12.2016	bis	25.12.2017	31,7%	31,7%
25.12.2017	bis	31.12.2018	-4,9%	2,5%
31.12.2018	bis	30.12.2019	22,2%	8,5%
30.12.2019	bis	28.12.2020	49,5%	21,0%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-4,5%	-4,5%

Depot seit Auflage am 04.09.2020

Das Depot „Deutschland & USA Trend“ setzen wir mit echtem Geld um. Gestartet ist das Depot am 04.09.2020 mit einem Kapital von 150.000€. Die Performance seitdem ist der folgenden Tabelle und dem Chart zu entnehmen. Transaktionskosten sind in der Auswertung bereits berücksichtigt, Steuern allerdings nicht.

Stand: 03.06.2022

	Depot "Deutschland & USA Trend"	CDAX + Nasdaq100
Rendite seit Auflage	+51,0%	+10,3%
Volatilität	27,8%	17,5%
Maximaler Drawdown	-22,4%	-22,6%



Europa Trend mit Safety

Vorstellung der Strategie

Die Strategie Europa Trend mit Safety investiert in die 30 besten Aktien aus Europa gemessen am Trend-Score. Damit eine Aktie für einen Kauf infrage kommt muss der Safety-Score außerdem über 50% liegen. Die Aufteilung auf die einzelnen Regionen sieht wie folgt aus: Deutschland (6), Niederlande + Belgien (4), Frankreich (4), Nordeuropa (5), Schweiz (4), England (4), Italien + Spanien (3).

Verkauft wird eine Aktie, wenn ihr Trend-Score unter 60% oder ihr Safety-Score unter 40% fällt. In diesem Fall wird die nächstbeste Aktie aus der Rangliste nach dem Trend-Score nachgekauft, wobei der Safety-Score größer sein muss als 50%.

Zusätzlich wird bei dieser Strategie unsere variable Investitionsquote berücksichtigt. Abhängig von der aktuellen Investitionsquote können auch weniger als die 30 vorgesehen Aktien im Depot vertreten sein. Die Depotzusammensetzung wird einmal wöchentlich überprüft

Die Benchmark dieses Depots ist der Stoxx600.

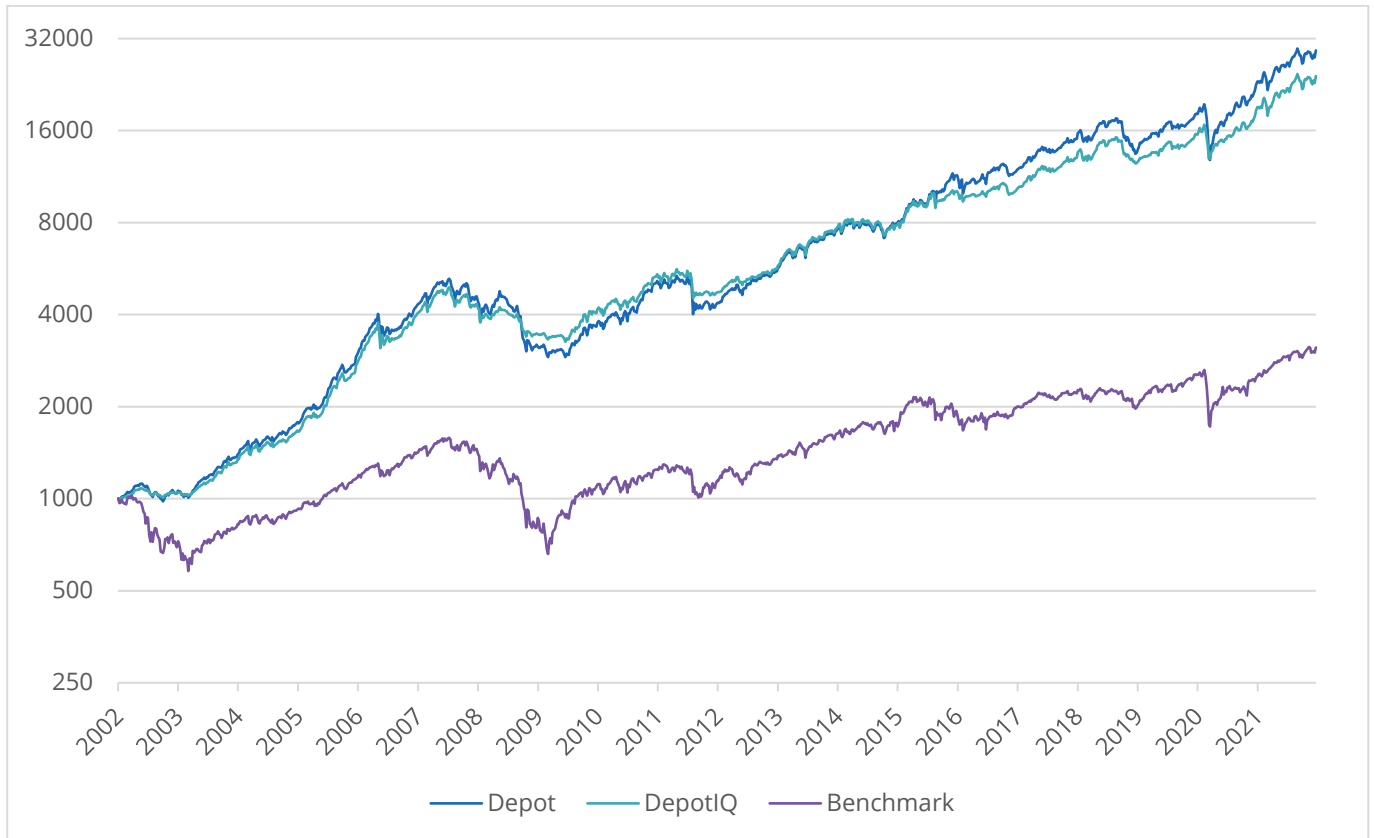
Echtgeld-Depot: Dieses Depot bilden wir 1:1 mit unserem eigenen Geld nach.

Die Depotzusammensetzung sowie die aktuellsten Trades finden Sie eins zu eins auf der Seite der Investmentstrategie im investolio-Premium-Bereich.

Diese Strategie eignet sich für Investoren, die in europäische Aktien (hauptsächlich Nebenwerte) investieren wollen und die mit größeren Schwankungen leben können. Die Strategie investiert gezielt in Aktien, die bereits einen starken Aufwärtstrend aufweisen. Gerade kurzfristig neigen diese Aktien allerdings zu größeren Schwankungen. Langfristig ist diese Strategie dafür aber in der Lage eine deutliche Outperformance zum Gesamtmarkt zu erzielen. Besonders in Phasen in denen am Aktienmarkt starke Trends vorliegen performt diese Strategie besonders gut.

Backtestergebnisse

	Depot	Depot IQ	Benchmark		
Annualisierte Rendite	18,3%	17,2%	5,9%	Anzahl Aktien im Depot	30
Annualisierte Volatilität	18,1%	14,7%	19,3%	Verkaufskriterium 1	Trend 60%
Maximaler Drawdown	44,6%	33,5%	58,4%	Verkaufskriterium 2	Safety 40%
Rendite-Risiko-Verhältnis	1,013	1,170	0,302	Depotumschlagsfaktor	1,73



Zeitraum	Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002 bis 27.12.2004	21,0%	18,4%	-2,9%	10,0%	8,3%	22,4%	12,5%	6,8%	43,3%
27.12.2004 bis 28.12.2009	15,6%	19,5%	3,6%	20,0%	16,5%	21,7%	44,6%	33,5%	58,4%
28.12.2009 bis 29.12.2014	16,7%	14,1%	10,1%	17,9%	14,8%	16,4%	25,1%	19,6%	22,1%
29.12.2014 bis 30.12.2019	17,9%	14,7%	7,4%	16,7%	13,6%	15,9%	23,5%	17,9%	22,2%
30.12.2019 bis 27.12.2021	26,9%	24,5%	10,9%	25,4%	19,3%	22,8%	34,1%	22,8%	34,8%

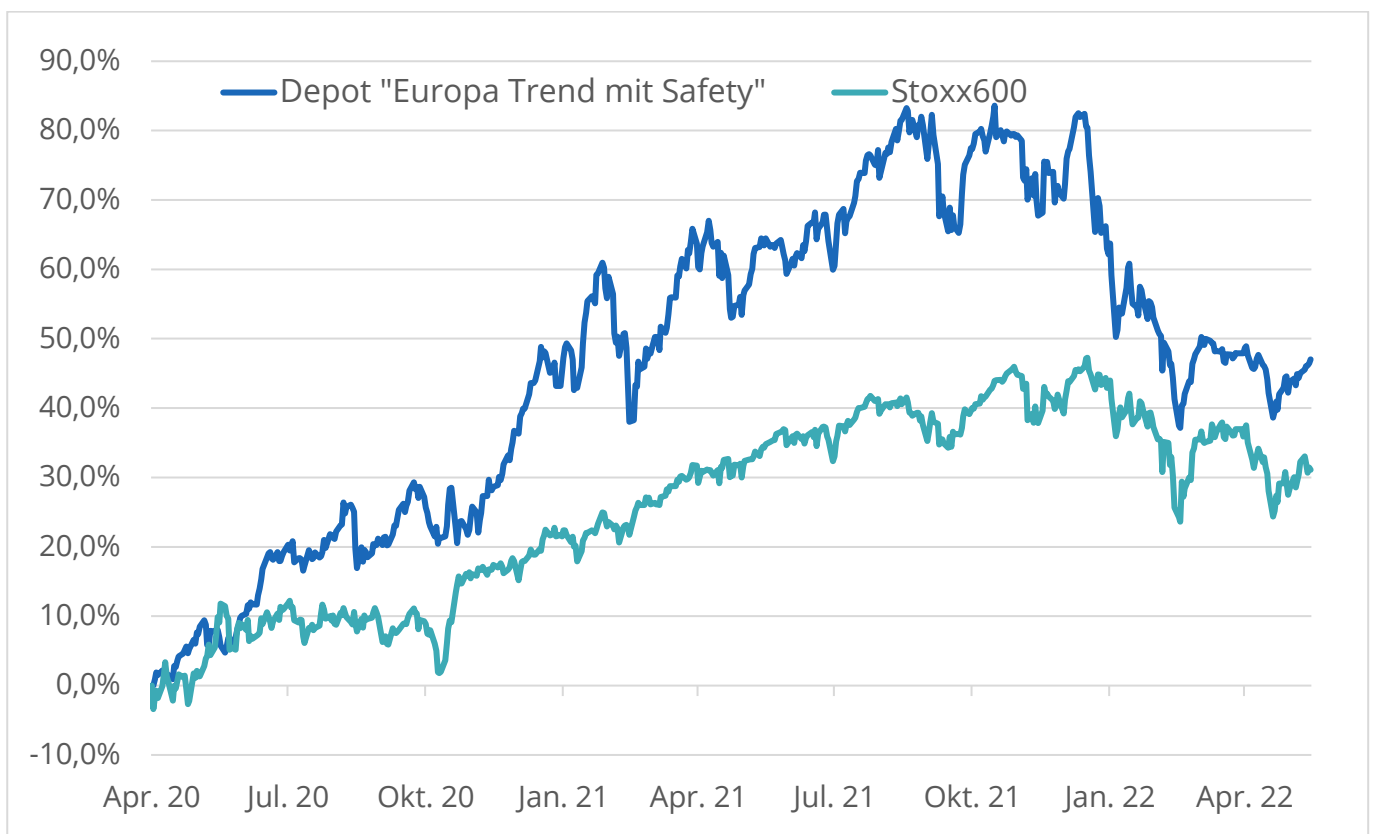
Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Depot IQ vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	34,6%	34,5%
30.12.2002	bis	29.12.2003	15,1%	10,0%
29.12.2003	bis	27.12.2004	15,6%	12,7%
27.12.2004	bis	26.12.2005	37,7%	37,2%
26.12.2005	bis	25.12.2006	25,0%	25,2%
25.12.2006	bis	31.12.2007	4,9%	5,7%
31.12.2007	bis	29.12.2008	14,2%	25,0%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-21,8%	-20,0%
28.12.2009	bis	27.12.2010	25,1%	18,1%
27.12.2010	bis	26.12.2011	-5,0%	-1,7%
26.12.2011	bis	31.12.2012	8,5%	-0,1%
31.12.2012	bis	30.12.2013	14,5%	14,5%
30.12.2013	bis	29.12.2014	-3,2%	-6,5%
29.12.2014	bis	28.12.2015	34,3%	19,8%
28.12.2015	bis	26.12.2016	0,9%	-1,6%
26.12.2016	bis	25.12.2017	15,8%	15,8%
25.12.2017	bis	31.12.2018	0,7%	6,9%
31.12.2018	bis	30.12.2019	6,4%	-3,4%
30.12.2019	bis	28.12.2020	26,1%	21,3%
28.12.2020	bis	27.12.2021	4,4%	4,4%

Depot seit Auflage am 20.04.2020

Das Depot „Europa Trend mit Safety“ setzen wir mit echtem Geld um. Gestartet ist das Depot am 20.04.2020 mit einem Kapital von 150.000€. Die Performance seitdem ist der folgenden Tabelle und dem Chart zu entnehmen. Transaktionskosten sind in der Auswertung bereits berücksichtigt, Steuern allerdings nicht.

Stand: 03.06.2022

	Depot "Europa Trend mit Safety"	Stoxx600
Rendite seit Auflage	+47,0%	+31,1%
Volatilität	20,0%	17,0%
Maximaler Drawdown	-25,3%	-16,1%



Europa Trend mit Value

Vorstellung der Strategie

Die Strategie Europa Trend mit Value investiert in die 30 besten Aktien aus Europa gemessen am Trend-Score. Damit eine Aktie für einen Kauf infrage kommt muss der Value-Score außerdem über 50% liegen. Die Aufteilung auf die einzelnen Regionen sieht wie folgt aus: Deutschland (7), Niederlande + Belgien (4), Frankreich (5), Nordeuropa (6), Schweiz (4), Italien + Spanien (4).

Verkauft wird eine Aktie, wenn ihr Trend-Score unter 60% oder ihr Value-Score unter 40% fällt. In diesem Fall wird die nächstbeste Aktie aus der Rangliste nach dem Trend-Score nachgekauft, wobei der Value-Score größer sein muss als 50%.

Zusätzlich wird bei dieser Strategie unsere variable Investitionsquote berücksichtigt. Abhängig von der aktuellen Investitionsquote können auch weniger als die 30 vorgesehen Aktien im Depot vertreten sein. Die Depotzusammensetzung wird einmal wöchentlich überprüft.

Die Benchmark dieses Depots ist der Stoxx600.

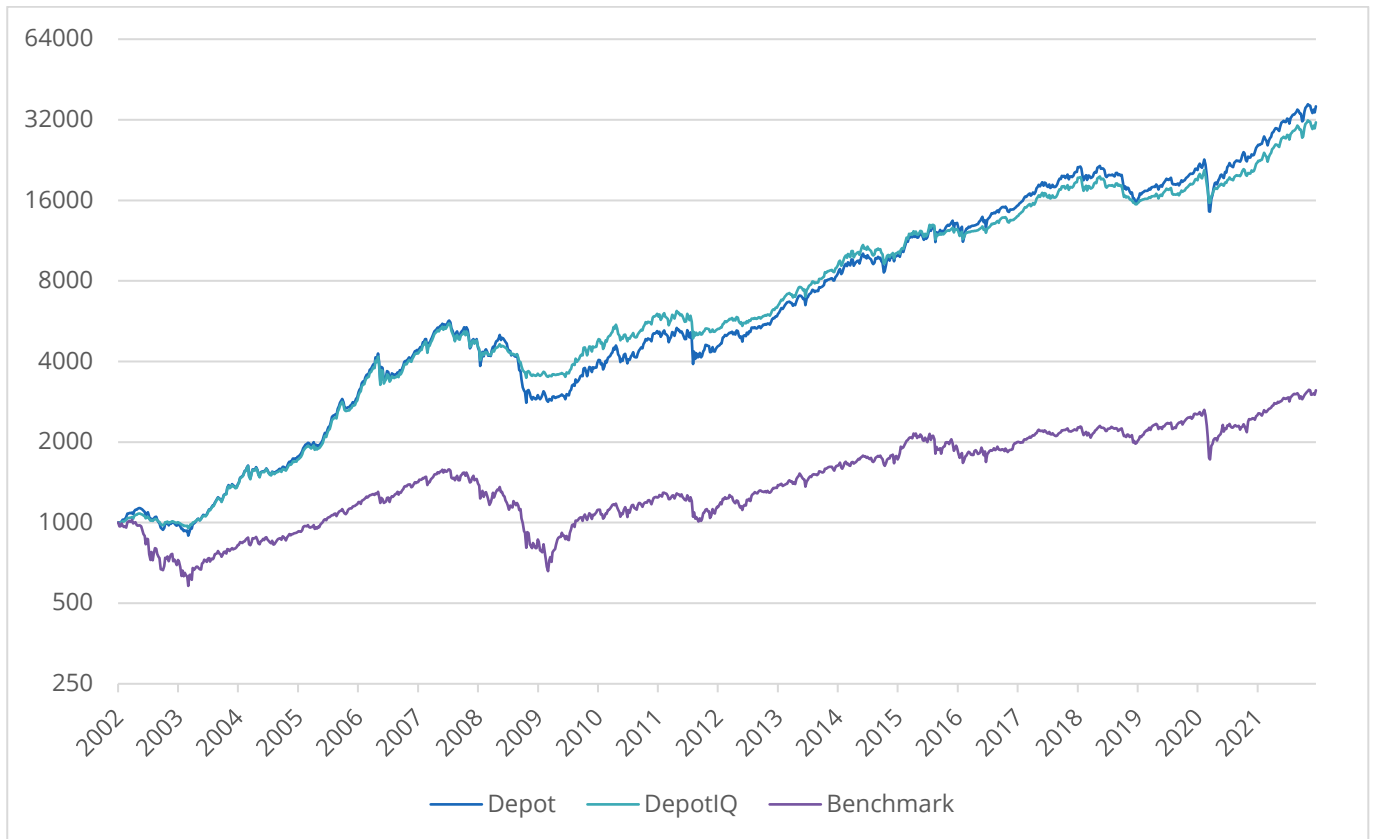
Echtgeld-Depot: Dieses Depot bilden wir 1:1 mit unserem eigenen Geld nach.

Die Depotzusammensetzung sowie die aktuellsten Trades finden Sie eins zu eins auf der Seite der Investmentstrategie im investolio-Premium-Bereich.

Diese Strategie eignet sich für Investoren, die in europäische Aktien (hauptsächlich Nebenwerte) investieren wollen und auf der Suche nach Trendaktien sind, allerdings gleichzeitig auf eine moderate Bewertung achten. Die Strategie investiert gezielt in Aktien, die bereits einen starken Aufwärtstrend aufweisen. Gerade kurzfristig neigen diese Aktien allerdings zu größeren Schwankungen. Langfristig ist diese Strategie dafür aber in der Lage eine deutliche Outperformance zum Gesamtmarkt zu erzielen. Durch die zusätzliche Betrachtung der Bewertung ist sichergestellt, dass das Depot zwar aus trendstarken Aktien besteht, aber immer eine solide fundamentale Basis vorhanden ist.

Backtestergebnisse

	Depot	Depot IQ	Benchmark			
Annualisierte Rendite	19,6%	18,7%	5,9%	Anzahl Aktien im Depot 30		
Annualisierte Volatilität	20,7%	17,0%	19,3%	Verkaufskriterium 1	Trend	60%
Maximaler Drawdown	50,7%	37,4%	58,4%	Verkaufskriterium 2	Value	40%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,944	1,103	0,302	Depotumschlagsfaktor	1,57	



Zeitraum	Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002 bis 27.12.2004	20,3%	19,2%	-2,9%	13,8%	11,6%	22,4%	21,1%	12,0%	43,3%
27.12.2004 bis 28.12.2009	16,9%	21,8%	3,6%	24,3%	20,4%	21,7%	50,7%	37,4%	58,4%
28.12.2009 bis 29.12.2014	21,0%	17,4%	10,1%	20,8%	17,3%	16,4%	26,6%	21,0%	22,1%
29.12.2014 bis 30.12.2019	16,1%	13,5%	7,4%	17,6%	14,3%	15,9%	26,7%	21,4%	22,2%
30.12.2019 bis 27.12.2021	30,9%	27,6%	10,9%	26,2%	19,5%	22,8%	36,0%	24,5%	34,8%

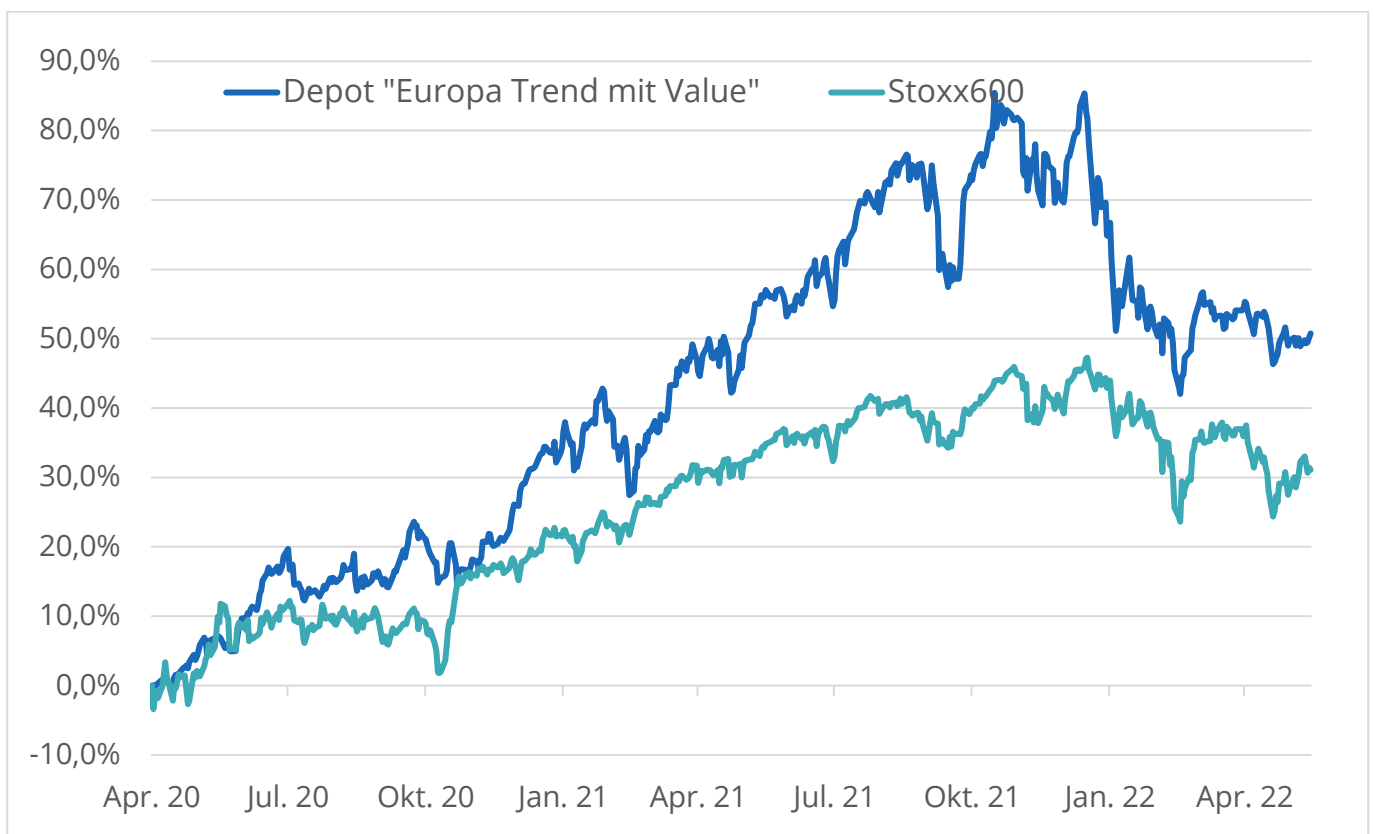
Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Depot IQ vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	28,0%	30,0%
30.12.2002	bis	29.12.2003	22,5%	18,8%
29.12.2003	bis	27.12.2004	14,8%	12,3%
27.12.2004	bis	26.12.2005	39,9%	39,8%
26.12.2005	bis	25.12.2006	30,6%	31,1%
25.12.2006	bis	31.12.2007	7,0%	8,5%
31.12.2007	bis	29.12.2008	4,7%	18,7%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-5,3%	-8,3%
28.12.2009	bis	27.12.2010	21,4%	17,4%
27.12.2010	bis	26.12.2011	-3,1%	-2,1%
26.12.2011	bis	31.12.2012	12,0%	1,1%
31.12.2012	bis	30.12.2013	20,3%	20,3%
30.12.2013	bis	29.12.2014	10,1%	4,4%
29.12.2014	bis	28.12.2015	23,2%	13,7%
28.12.2015	bis	26.12.2016	12,6%	8,1%
26.12.2016	bis	25.12.2017	23,6%	23,6%
25.12.2017	bis	31.12.2018	-12,3%	-6,7%
31.12.2018	bis	30.12.2019	5,3%	-3,5%
30.12.2019	bis	28.12.2020	21,3%	15,5%
28.12.2020	bis	27.12.2021	18,1%	18,1%

Depot seit Auflage am 20.04.2020

Das Depot „Europa Trend mit Value“ setzen wir mit echtem Geld um. Gestartet ist das Depot am 20.04.2020 mit einem Kapital von 150.000€. Die Performance seitdem ist der folgenden Tabelle und dem Chart zu entnehmen. Transaktionskosten sind in der Auswertung bereits berücksichtigt, Steuern allerdings nicht.

Stand: 03.06.2022

	Depot "Europa Trend mit Value"	Stoxx600
Rendite seit Auflage	+50,8%	+31,1%
Volatilität	19,3%	17,0%
Maximaler Drawdown	-23,4%	-16,1%



Europa Technisch

Vorstellung der Strategie

Die Strategie Europa Technisch investiert in die 25 besten Aktien aus Europa gemessen am Technischen Score. Die Aufteilung auf die einzelnen Regionen sieht wie folgt aus: Deutschland (6), Niederlande + Belgien (4), Frankreich (5), Nordeuropa (6), Schweiz (4).

Verkauft wird eine Aktie, wenn ihr Technischer Score unter 70% fällt. In diesem Fall wird die nächstbeste Aktie aus der Rangliste nach dem Technischen Score nachgekauft.

Zusätzlich wird bei dieser Strategie unsere variable Investitionsquote berücksichtigt. Abhängig von der aktuellen Investitionsquote können auch weniger als die 25 vorgesehen Aktien im Depot vertreten sein. Die Depotzusammensetzung wird einmal wöchentlich überprüft.

Die Benchmark dieses Depots ist der Stoxx600.

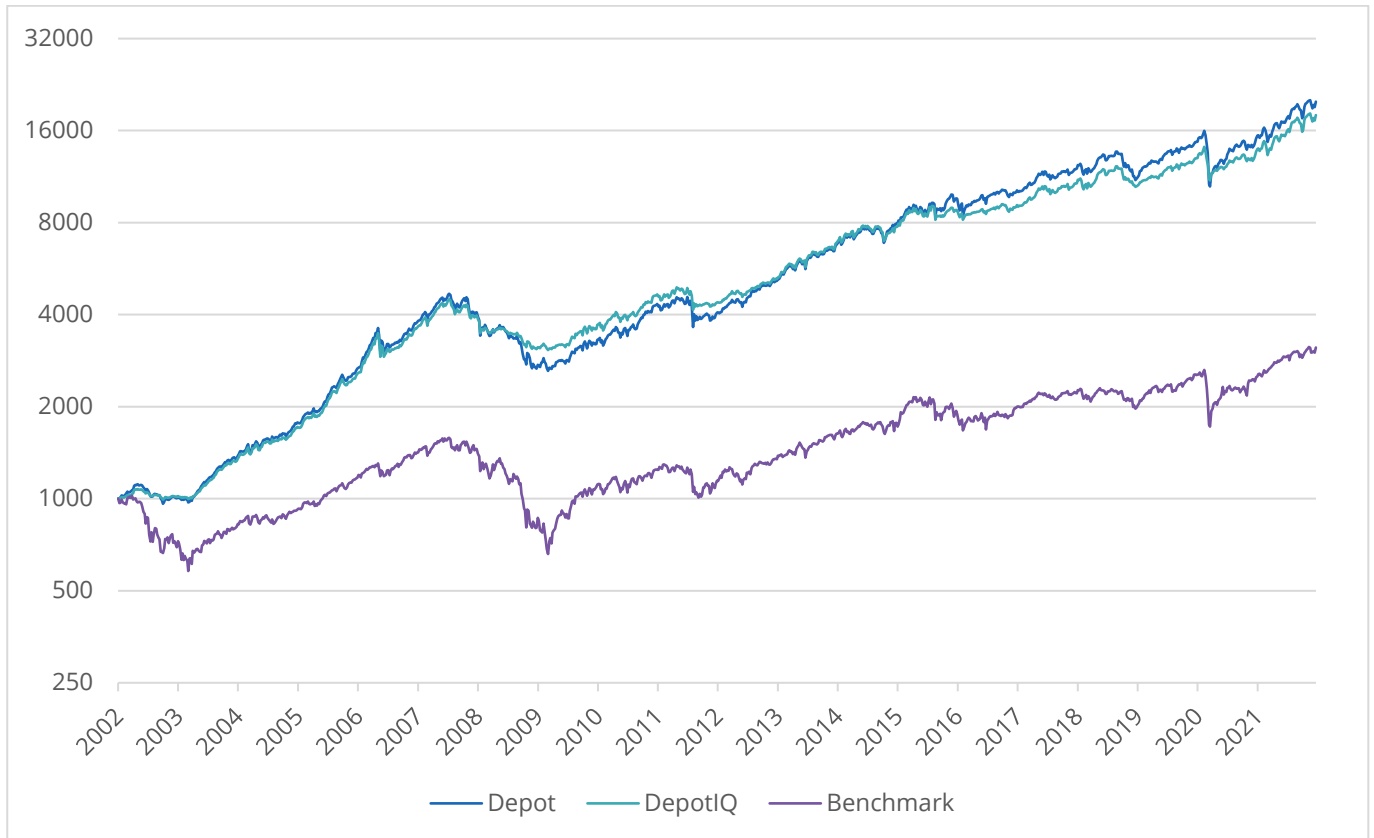
Bei diesem Depot handelt es sich um ein reines Musterdepot.

Die Depotzusammensetzung sowie die aktuellsten Trades finden Sie eins zu eins auf der Seite der Investmentstrategie im investolio-Premium-Bereich.

Diese Strategie eignet sich für Investoren, die in europäische Aktien (hauptsächlich Nebenwerte) investieren wollen und die mit größeren Schwankungen leben können. Die Strategie achtet darauf in Aktien mit einem starken Trend mit gleichzeitig geringen Kursschwankungen zu investieren. Langfristig ist diese Strategie dafür aber in der Lage eine deutliche Outperformance zum Gesamtmarkt zu erzielen. Besonders in Phasen in denen am Aktienmarkt starke Trends vorliegen performt diese Strategie besonders gut.

Backtestergebnisse

	Depot	Depot IQ	Benchmark		
Annualisierte Rendite	16,1%	15,5%	5,9%	Anzahl Aktien im Depot	25
Annualisierte Volatilität	16,0%	13,0%	19,3%	Verkaufskriterium	Technisch 70%
Maximaler Drawdown	44,0%	31,8%	58,4%	Depotumschlagsfaktor	1,51
Rendite-Risiko-Verhältnis	1,002	1,190	0,302		



Zeitraum	Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002 bis 27.12.2004	20,9%	19,5%	-2,9%	9,0%	7,5%	22,4%	13,6%	7,8%	43,3%
27.12.2004 bis 28.12.2009	12,7%	16,1%	3,6%	17,5%	14,6%	21,7%	44,0%	31,8%	58,4%
28.12.2009 bis 29.12.2014	19,8%	16,6%	10,1%	15,6%	12,9%	16,4%	20,2%	15,6%	22,1%
29.12.2014 bis 30.12.2019	13,0%	10,8%	7,4%	14,4%	11,9%	15,9%	19,3%	14,3%	22,2%
30.12.2019 bis 27.12.2021	16,5%	17,8%	10,9%	24,0%	17,7%	22,8%	34,3%	22,3%	34,8%

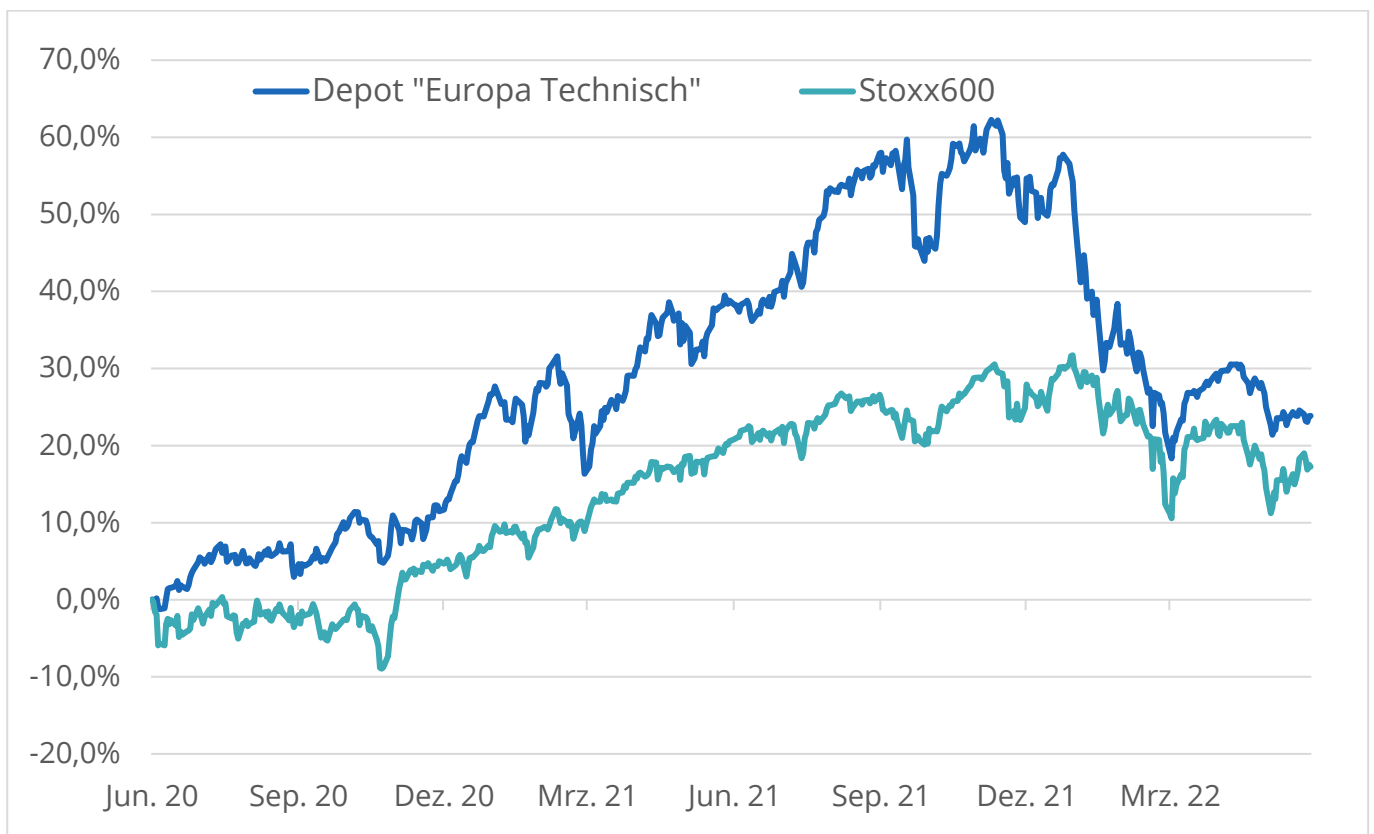
Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Depot IQ vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	30,9%	31,9%
30.12.2002	bis	29.12.2003	18,6%	14,3%
29.12.2003	bis	27.12.2004	16,7%	15,1%
27.12.2004	bis	26.12.2005	21,7%	21,2%
26.12.2005	bis	25.12.2006	22,1%	21,9%
25.12.2006	bis	31.12.2007	5,3%	6,9%
31.12.2007	bis	29.12.2008	10,2%	22,6%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-15,8%	-20,0%
28.12.2009	bis	27.12.2010	20,1%	14,9%
27.12.2010	bis	26.12.2011	3,3%	4,2%
26.12.2011	bis	31.12.2012	8,5%	-0,1%
31.12.2012	bis	30.12.2013	10,2%	10,2%
30.12.2013	bis	29.12.2014	8,8%	4,2%
29.12.2014	bis	28.12.2015	11,7%	4,3%
28.12.2015	bis	26.12.2016	2,2%	-0,2%
26.12.2016	bis	25.12.2017	7,2%	7,2%
25.12.2017	bis	31.12.2018	3,5%	8,8%
31.12.2018	bis	30.12.2019	3,9%	-4,6%
30.12.2019	bis	28.12.2020	4,5%	6,9%
28.12.2020	bis	27.12.2021	6,8%	6,8%

Depot seit Auflage am 07.06.2020

Das Depot „Europa Technisch“ haben wir bis zum 07.06.2022 mit echtem Geld umgesetzt. Seitdem wird dieses Depot als Musterdepot fortgeführt. Gestartet ist das Depot am 07.06.2020 mit einem Kapital von 125.000€. Die Performance seitdem ist der folgenden Tabelle und dem Chart zu entnehmen. Transaktionskosten sind in der Auswertung bereits berücksichtigt, Steuern allerdings nicht.

Stand: 03.06.2022

	Depot "Europa Technisch"	Stoxx600
Rendite seit Auflage	+23,9%	+17,3%
Volatilität	17,4%	16,1%
Maximaler Drawdown	-27,1%	-16,1%



Europa Value mit Trend

Vorstellung der Strategie

Die Strategie Europa Value mit Trend investiert in die 30 besten Aktien aus Europa gemessen am Value-Score. Damit eine Aktie für einen Kauf infrage kommt muss der Trend-Score außerdem über 60% liegen. Die Aufteilung auf die einzelnen Regionen sieht wie folgt aus: Deutschland (6), Frankreich (6), Nordeuropa (6), Niederlande + Belgien (4), Schweiz (4), Italien + Spanien (4).

Verkauft wird eine Aktie, wenn ihr Value-Score unter 60% oder ihr Trend-Score unter 40% fällt. In diesem Fall wird die nächstbeste Aktie aus der Rangliste nach dem Value-Score nachgekauft, wobei der Trend-Score größer sein muss als 60%.

Zusätzlich wird bei dieser Strategie unsere variable Investitionsquote berücksichtigt. Abhängig von der aktuellen Investitionsquote können auch weniger als die 30 vorgesehen Aktien im Depot vertreten sein. Die Depotzusammensetzung wird einmal wöchentlich überprüft.

Die Benchmark für dieses Depot ist der Stoxx600.

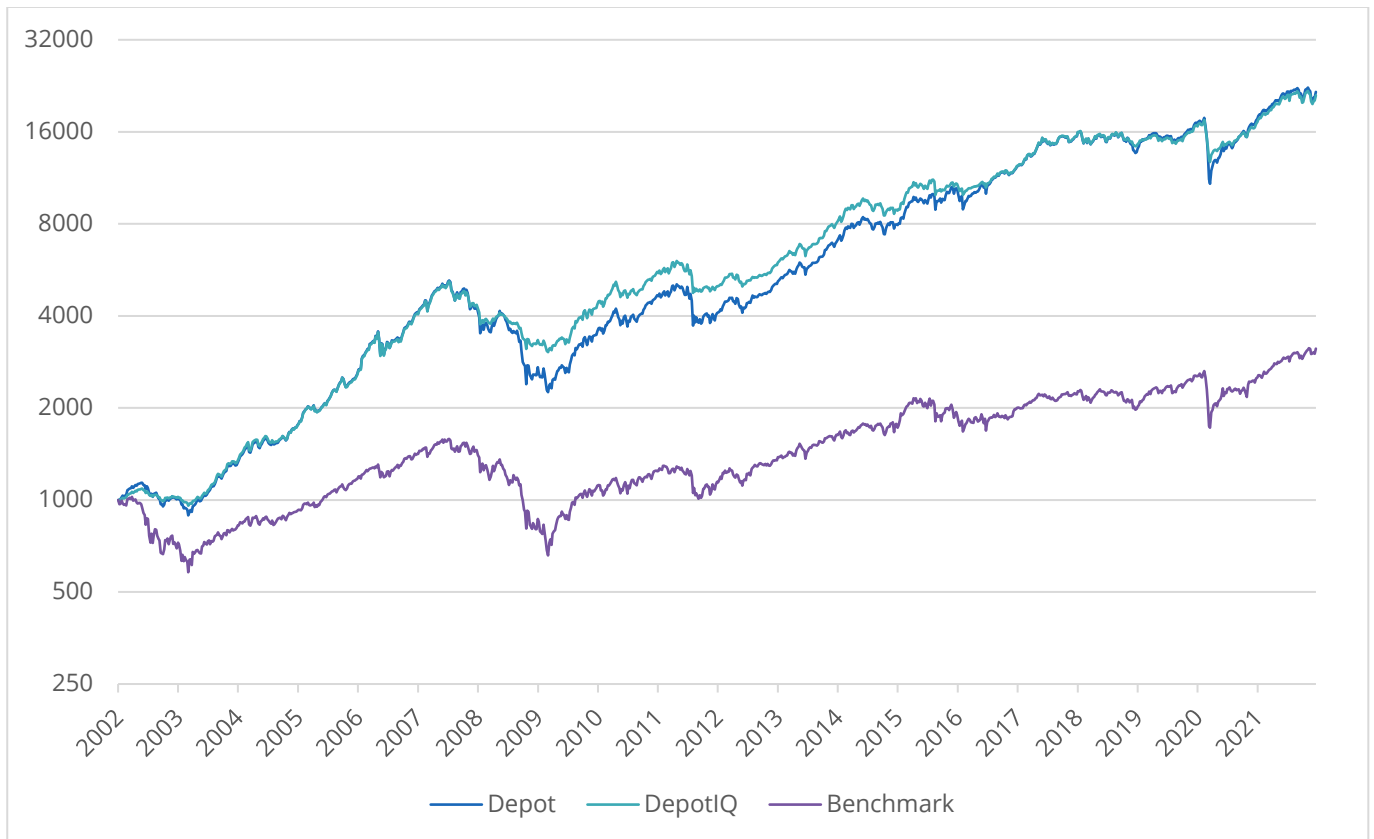
Echtgeld-Depot: Dieses Depot bilden wir 1:1 mit unserem eigenen Geld nach.

Die Depotzusammensetzung sowie die aktuellsten Trades finden Sie eins zu eins auf der Seite der Investmentstrategie im investolio-Premium-Bereich.

Diese Strategie eignet sich für Investoren, die in europäische Aktien (hauptsächlich Nebenwerte) investieren wollen und einen Wert auf Unternehmen mit günstiger Bewertung und hoher Profitabilität legen. Durch das zusätzliche Filterkriterium nach dem Trend-Score wird vermieden langfristig in „Value-Fallen“ (also Aktien, die zwar günstig sind, aber trotzdem ständig fallen) investiert zu sein. Value-Aktien gelten als zyklische Aktien und können damit kurzfristig auch stärker schwanken. Gleichzeitig bietet der Value-Fokus allerdings auch eine höhere Sicherheit, weil gezielt in profitable Unternehmen mit solider fundamentaler Basis investiert wird.

Backtestergebnisse

	Depot	Depot IQ	Benchmark		
Annualisierte Rendite	16,6%	16,4%	5,9%	Anzahl Aktien im Depot 30	
Annualisierte Volatilität	18,6%	14,5%	19,3%	Verkaufskriterium 1 Value 60%	
Maximaler Drawdown	56,9%	41,2%	58,4%	Verkaufskriterium 2 Trend 40%	
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,891	1,129	0,302	Depotumschlagsfaktor 1,33	



Zeitraum	Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002 bis 27.12.2004	20,2%	20,0%	-2,9%	12,1%	9,5%	22,4%	21,9%	12,0%	43,3%
27.12.2004 bis 28.12.2009	14,9%	19,7%	3,6%	23,2%	18,0%	21,7%	56,9%	41,2%	58,4%
28.12.2009 bis 29.12.2014	18,0%	15,9%	10,1%	17,8%	14,6%	16,4%	26,8%	21,4%	22,1%
29.12.2014 bis 30.12.2019	16,5%	13,6%	7,4%	14,8%	12,1%	15,9%	15,7%	11,1%	22,2%
30.12.2019 bis 27.12.2021	12,3%	11,9%	10,9%	23,7%	16,6%	22,8%	39,2%	26,9%	34,8%

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Depot IQ vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	31,0%	32,2%
30.12.2002	bis	29.12.2003	13,0%	13,4%
29.12.2003	bis	27.12.2004	19,8%	17,4%
27.12.2004	bis	26.12.2005	19,2%	18,7%
26.12.2005	bis	25.12.2006	40,6%	40,4%
25.12.2006	bis	31.12.2007	1,3%	3,7%
31.12.2007	bis	29.12.2008	4,6%	19,3%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-0,8%	-5,2%
28.12.2009	bis	27.12.2010	19,4%	15,8%
27.12.2010	bis	26.12.2011	-2,9%	0,2%
26.12.2011	bis	31.12.2012	6,3%	-2,1%
31.12.2012	bis	30.12.2013	16,2%	16,2%
30.12.2013	bis	29.12.2014	5,4%	1,8%
29.12.2014	bis	28.12.2015	22,1%	12,9%
28.12.2015	bis	26.12.2016	13,8%	10,1%
26.12.2016	bis	25.12.2017	14,8%	14,8%
25.12.2017	bis	31.12.2018	-0,5%	3,4%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-2,8%	-10,7%
30.12.2019	bis	28.12.2020	3,3%	2,7%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-1,1%	-1,1%

Depot seit Auflage am 07.06.2022

Dieses Depot wurde erst vor Kurzem aufgelegt. Details zur Performance im Live-Betrieb folgen demnächst.

USA Value mit Trend

Vorstellung der Strategie

Die Strategie USA Value mit Trend investiert in die 20 besten Aktien aus dem S&P 900 (USA) gemessen am Value-Score. Damit eine Aktie für einen Kauf infrage kommt muss der Trend-Score außerdem über 60% liegen. Die Unternehmen müssen eine Mindest-Marktkapitalisierung aufweisen, die sich an der Entwicklung des S&P 900 orientiert. Aktuell liegt diese Grenze bei umgerechnet 15 Milliarden Euro.

Verkauft wird eine Aktie, wenn ihr Value-Score unter 60% oder ihr Trend-Score unter 40% fällt. In diesem Fall wird die nächstbeste Aktie aus der Rangliste nach dem Value-Score nachgekauft, wobei der Trend-Score größer sein muss als 60%.

Bei dieser Strategie wird unsere variable Investitionsquote nicht berücksichtigt. Die Depotzusammensetzung wird einmal wöchentlich überprüft.

Die Benchmark für dieses Depot ist der S&P 900.

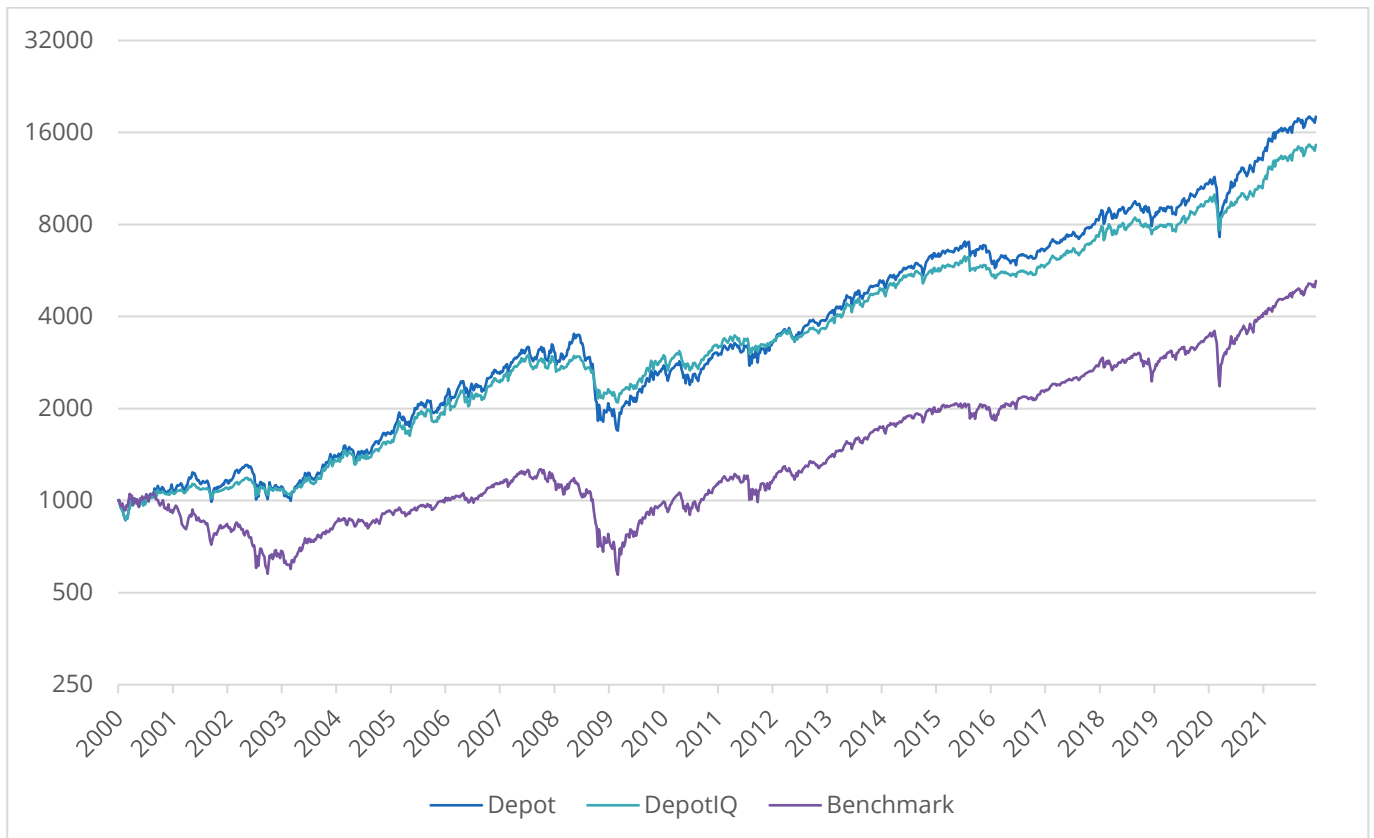
Echtgeld-Depot: Dieses Depot bilden wir 1:1 mit unserem eigenen Geld nach.

Die Depotzusammensetzung sowie die aktuellsten Trades finden Sie eins zu eins auf der Seite der Investmentstrategie im investolio-Premium-Bereich.

Diese Strategie eignet sich für Investoren, die in amerikanische Aktien investieren wollen und einen Wert auf Unternehmen mit günstiger Bewertung und hoher Profitabilität legen. Der Fokus liegt auf US-Large-Caps und US-Mid-Caps. Durch das zusätzliche Filterkriterium nach dem Trend-Score wird vermieden langfristig in „Value-Fallen“ (also Aktien, die zwar günstig sind, aber trotzdem ständig fallen) investiert zu sein. Value-Aktien gelten als zyklische Aktien und können damit kurzfristig auch stärker schwanken. Gleichzeitig bietet der Value-Fokus allerdings auch eine höhere Sicherheit, weil gezielt in profitable Unternehmen mit solider fundamentaler Basis investiert wird.

Backtestergebnisse

	Depot	Depot IQ	Benchmark		
Annualisierte Rendite	14,0%	12,9%	7,8%	Anzahl Aktien im Depot 20	
Annualisierte Volatilität	20,0%	15,1%	18,8%	Verkaufskriterium 1 Value 60%	
Maximaler Drawdown	51,8%	29,9%	54,9%	Verkaufskriterium 2 Trend 40%	
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,701	0,857	0,415	Depotumschlagsfaktor 1,25	



Zeitraum	Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
10.01.2000 bis 27.12.2004	10,7%	9,2%	-1,5%	19,2%	13,7%	19,2%	23,8%	13,6%	45,7%
27.12.2004 bis 28.12.2009	10,2%	13,4%	1,0%	23,4%	17,5%	21,8%	51,8%	29,9%	54,9%
28.12.2009 bis 29.12.2014	19,0%	14,6%	15,6%	17,2%	13,7%	16,7%	16,4%	13,8%	19,2%
29.12.2014 bis 30.12.2019	11,0%	10,5%	11,1%	15,4%	12,9%	14,2%	18,2%	15,2%	19,4%
30.12.2019 bis 27.12.2021	28,8%	23,8%	23,6%	28,1%	19,7%	24,2%	36,4%	23,6%	34,2%

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Depot IQ vs. Benchmark
10.01.2000	bis	25.12.2000	16,2%	13,9%
25.12.2000	bis	31.12.2001	17,9%	14,2%
31.12.2001	bis	30.12.2002	14,3%	19,5%
30.12.2002	bis	29.12.2003	1,1%	-3,0%
29.12.2003	bis	27.12.2004	7,0%	3,1%
27.12.2004	bis	26.12.2005	17,8%	17,5%
26.12.2005	bis	25.12.2006	12,2%	13,1%
25.12.2006	bis	31.12.2007	16,9%	13,9%
31.12.2007	bis	29.12.2008	0,7%	15,9%
29.12.2008	bis	28.12.2009	2,7%	-4,8%
28.12.2009	bis	27.12.2010	-1,6%	-3,8%
27.12.2010	bis	26.12.2011	3,7%	-0,6%
26.12.2011	bis	31.12.2012	4,4%	-4,4%
31.12.2012	bis	30.12.2013	3,6%	3,6%
30.12.2013	bis	29.12.2014	7,1%	1,0%
29.12.2014	bis	28.12.2015	1,7%	-0,5%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-12,0%	-11,0%
26.12.2016	bis	25.12.2017	4,8%	4,8%
25.12.2017	bis	31.12.2018	5,7%	9,1%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-0,9%	-6,6%
30.12.2019	bis	28.12.2020	2,8%	-6,2%
28.12.2020	bis	27.12.2021	7,7%	7,7%

Depot seit Auflage am 07.06.2022

Dieses Depot wurde erst vor Kurzem aufgelegt. Details zur Performance im Live-Betrieb folgen demnächst.

USA Safety

Vorstellung der Strategie

Die Strategie USA Safety investiert in die 20 besten Aktien aus dem S&P 900 (USA) gemessen am Safety-Score. Die Unternehmen müssen eine Mindest-Marktkapitalisierung aufweisen, die sich an der Entwicklung des S&P 900 orientiert. Aktuell liegt diese Grenze bei umgerechnet 15 Milliarden Euro.

Verkauft wird eine Aktie, wenn ihr Safety-Score unter 80% fällt. In diesem Fall wird die nächstbeste Aktie aus der Rangliste nach dem Safety-Score nachgekauft.

Bei dieser Strategie wird unsere variable Investitionsquote nicht berücksichtigt. Die Depotzusammensetzung wird einmal wöchentlich überprüft.

Die Benchmark für dieses Depot ist der S&P 900.

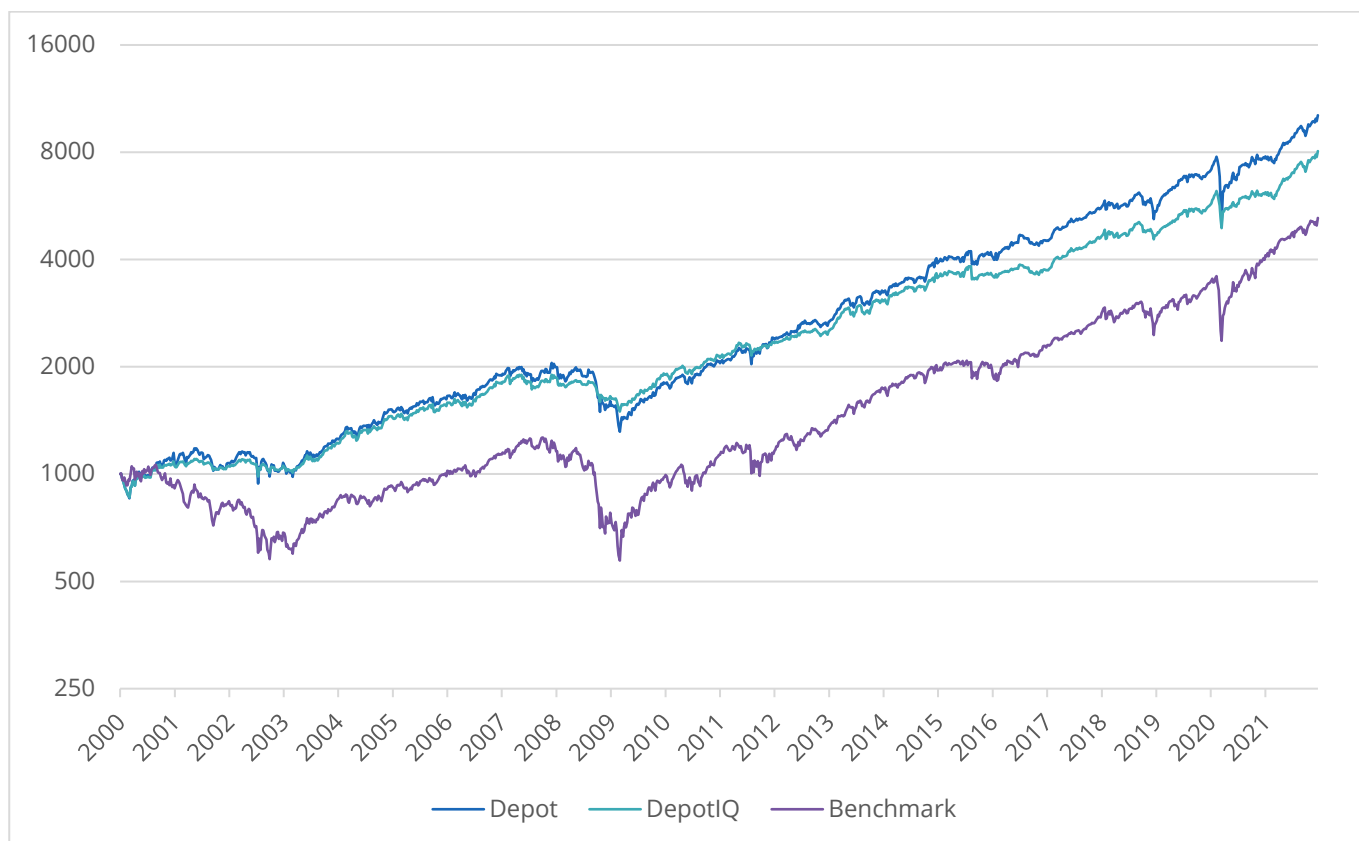
Dieses Depot ist ein reines Musterdepot.

Die Depotzusammensetzung sowie die aktuellsten Trades finden Sie eins zu eins auf der Seite der Investmentstrategie im investolio-Premium-Bereich.

Diese Strategie eignet sich für Investoren, die in amerikanische Aktien investieren wollen und einen Wert auf Aktien mit niedrigen Schwankungen und somit einem geringen Risiko legen. Der Fokus liegt auf US-Large-Caps und US-Mid-Caps. Der Safety-Score sucht gezielt nach Aktien mit geringen Kursschwankungen. Diese Strategie eignet sich daher besonders für Investoren, die ihr Depot defensiver ausrichten wollen und langfristig die Schwankungen des Aktienmarktes glätten wollen. Diese Risikoreduktion kann allerdings auch mit einer niedrigen Rendite einhergehen.

Backtestergebnisse

	Depot	Depot IQ	Benchmark		
Annualisierte Rendite	11,1%	9,9%	7,8%	Anzahl Aktien im Depot	20
Annualisierte Volatilität	14,3%	10,3%	18,8%	Verkaufskriterium	Safety 80%
Maximaler Drawdown	35,8%	21,4%	54,9%	Depotumschlagsfaktor	0,57
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,775	0,968	0,415		



Zeitraum	Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
10.01.2000 bis 27.12.2004	8,8%	7,8%	-1,5%	14,5%	9,9%	19,2%	20,3%	14,1%	45,7%
27.12.2004 bis 28.12.2009	3,5%	5,6%	1,0%	13,9%	10,2%	21,8%	35,8%	21,1%	54,9%
28.12.2009 bis 29.12.2014	17,3%	13,8%	15,6%	10,5%	8,7%	16,7%	10,0%	8,1%	19,2%
29.12.2014 bis 30.12.2019	11,7%	9,0%	11,1%	11,5%	9,5%	14,2%	15,8%	10,6%	19,4%
30.12.2019 bis 27.12.2021	20,1%	19,4%	23,6%	25,4%	15,4%	24,2%	34,8%	21,4%	34,2%

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Depot IQ vs. Benchmark
10.01.2000	bis	25.12.2000	18,8%	14,7%
25.12.2000	bis	31.12.2001	7,0%	8,7%
31.12.2001	bis	30.12.2002	18,4%	20,1%
30.12.2002	bis	29.12.2003	-8,2%	-11,2%
29.12.2003	bis	27.12.2004	10,0%	8,1%
27.12.2004	bis	26.12.2005	-0,3%	-0,3%
26.12.2005	bis	25.12.2006	2,6%	1,9%
25.12.2006	bis	31.12.2007	-0,6%	-2,6%
31.12.2007	bis	29.12.2008	17,1%	26,6%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-17,5%	-16,2%
28.12.2009	bis	27.12.2010	-0,2%	-2,7%
27.12.2010	bis	26.12.2011	14,1%	7,0%
26.12.2011	bis	31.12.2012	-7,4%	-10,5%
31.12.2012	bis	30.12.2013	-6,6%	-6,6%
30.12.2013	bis	29.12.2014	7,8%	3,1%
29.12.2014	bis	28.12.2015	3,8%	0,0%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-5,2%	-11,0%
26.12.2016	bis	25.12.2017	1,7%	1,7%
25.12.2017	bis	31.12.2018	3,6%	7,2%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-1,6%	-9,8%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-8,0%	-9,2%
28.12.2020	bis	27.12.2021	1,6%	1,6%

Depot seit Auflage am 07.06.2022

Dieses Depot wurde erst vor Kurzem aufgelegt. Details zur Performance im Live-Betrieb folgen demnächst.