



Informationen für Anleger

ETF-Management Modell

Donnerstag, 4. November 2021



Zielsetzung

Mit möglichst geringem Investitionsgrad und Drawdown eine Rendite erzielen, die zumindest der des MSCI World entspricht. Motto: Lieber kein Geld verdienen als Geld verlieren. Das Modell will in diesem Sinne ganzexplizit langweilig sein.

Vorgehensweise

Angewendet wird das in 40 Jahren gewonnene Kernwissen von Wieland Staud. Das Modell basiert auf lediglich zwei technischen Indikationen und einem Stoploss-Kriterium. Das Ergebnis ist stabil und nicht das Ergebnis einer auf die Spitze getriebenen Optimierung.

Ergebnis

Durchschnittliche Performance p.a.:	8,4%	(MSCI: 7,7%)
Maximaler DrawDown:	17,7%	(MSCI: 65,3%)
Durchschnittlicher Investitionsgrad:	42,3%	
Minusjahre:	3 (nächste Seite)	

Verhaltenscharakteristik

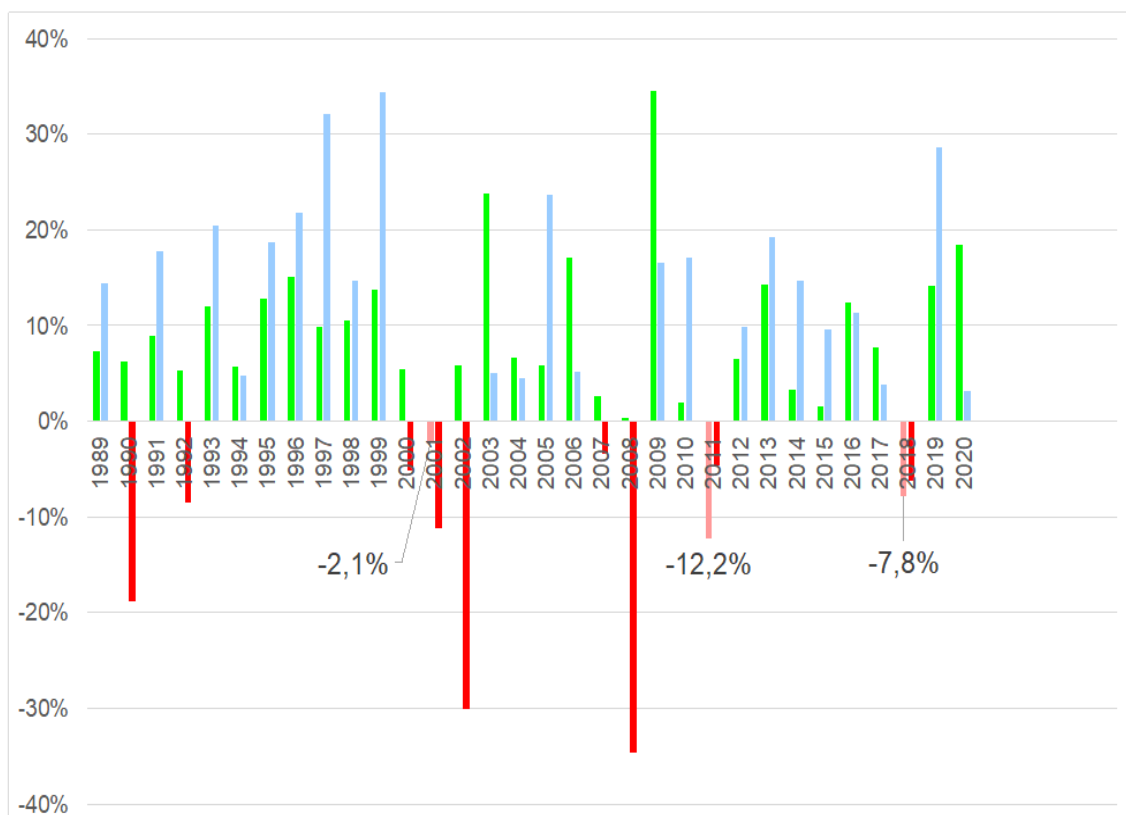
In Aufwärtstrends bleibt die Wertentwicklung des Modells hinter dem MSCI World zurück, in Abwärtstrends liegt es Modell weit vorne.

Beitrag zur Analyse

Je länger die Underperformance des Modells in Aufwärtstrends anhält, desto näher ist sein Ende. Je weiter die Outperformance in Abwärtstrends gediehen ist, desto näher ist eine Wende nach oben. Auffallend: Aktuell hält die Underperformance schon sehr lange an.



Jährliche Wertentwicklung seit 1988

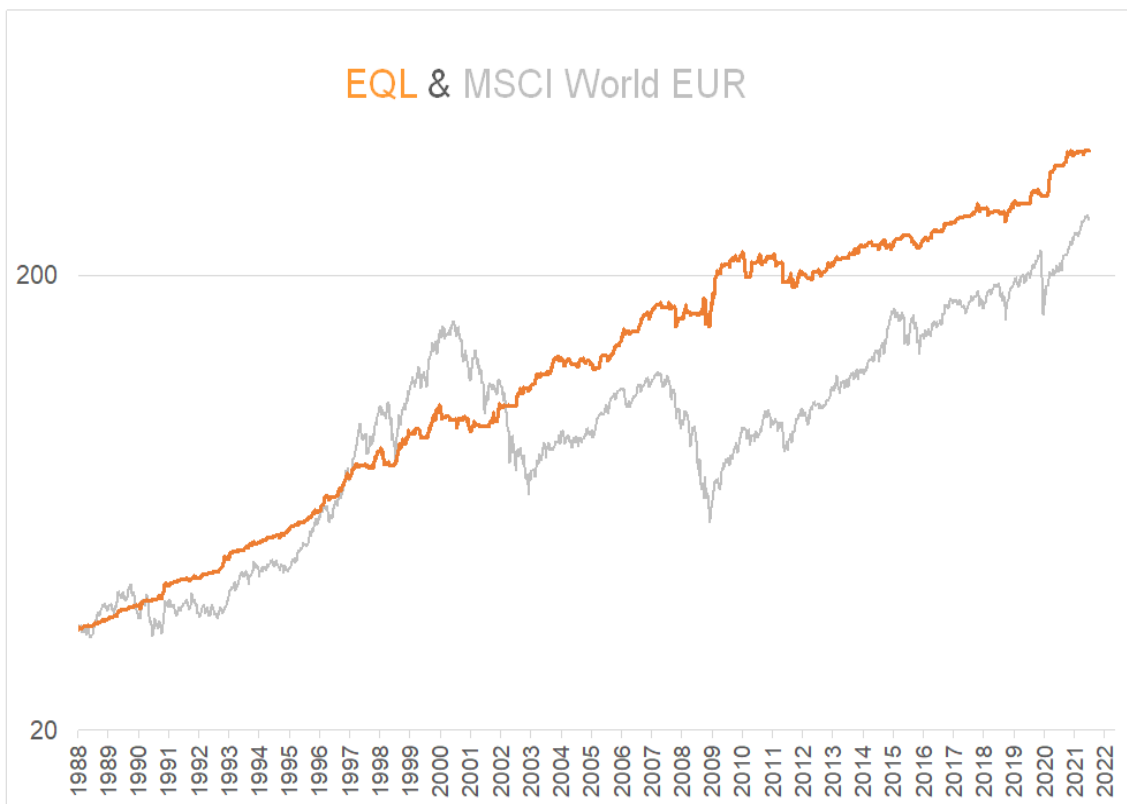


ETF-Modell: Hellblau & Hellrot

MSCI World EUR: Grün & Dunkelrot



Modell vs. MSCI World (EUR)





Kennzahlen

		Modell	MSCI EUR	
Wertentwicklung p.a.	Mittelwert	8,4%	7,7%	
	Max	34,5%	34,4%	
	Min	-12,2%	-34,7%	
Drawdown Max.		-17,5%	-65,3%	
Mitt. Entwicklung Aktien / Woche		0,29%		
MinusJahre		3	10%	
	Mittelwert	-7,4%		
Max. rollierende 12 Minusmonate		12,6		
Investitionsgrad	durchschnittlich	42,3%		
	maximal	100%	4,8%	der Zeit
	minimal	0%	1,6%	der Zeit
Mittlere Haltedauer einer Position		9,6	Wochen	
Längste Gewinnserie		28	Wochen	
Längste Verlustserie		7	Wochen	



Erläuterungen

1. Alle Angaben beruhen auf der Auswertung der jeweiligen Wochenschlusskursen seit Mitte 1988.
2. Alle Angabe berücksichtigen Transkosten von 0,10% Halfturn.
3. Dividenden werden nicht berücksichtigt. Sie würden das durchschnittliche Jahresergebnis um ca. 1%-Punkt verbessern.
4. Cash-Positionen werden zum jeweiligen Zeitpunkt mit der um einen Prozentpunkt reduzierten, aktuellen deutschen Umlaufrendite verzinst. Bei Minuszinsen wird Cash nicht investiert.
5. Das Modell umfasst insgesamt 15 Märkte, u.a. den S&P500, Dow Jones, NASDAQ100, RTX, Shanghai Comp., Nikkei 225, KursDAX, EuroStoxx50, Bovespa, SOX, NASDAQ Biotechnologie etc.
6. Kennziffern und Charts zeigen die Sicht eines EUR-Anlegers.

Bitte beachten Sie: Das Modell wird wahrscheinlich gerade von Vertretern von Staud Research gehandelt.

Für weitergehende Informationen: Kontaktieren Sie uns unter info@staud.research.de oder rufen Sie uns an (06172-287808).



Haftung für Informationen

Staud Research übernimmt keine Haftung für bereitgestellte Handelsanregungen. Diese stellen in keiner Weise einen Aufruf zur individuellen oder allgemeinen Nachbildung, auch nicht stillschweigend, dar. Handelsanregungen oder anderweitige Informationen stellen keine Aufforderung zum Kauf oder Verkauf von Wertpapieren oder derivativen Finanzprodukten dar. Eine Haftung für mittelbare und unmittelbare Folgen der veröffentlichten Inhalte ist somit ausgeschlossen.

Staud Research bezieht Informationen aus Quellen, die sie als vertrauenswürdig erachtet. Eine Gewähr hinsichtlich Qualität und Wahrheitsgehalt dieser Informationen kann gleichwohl nicht übernommen werden.

Leser, die aufgrund der veröffentlichten Inhalte Anlageentscheidungen treffen bzw. Transaktionen durchführen, handeln in vollem Umfang auf eigene Gefahr und auf eigenes Risiko. Staud Research übernimmt keine Haftung für die erteilten Informationen. Insbesondere weisen wir hierbei auf die bei Geschäften mit Optionsscheinen, Derivaten und derivativen Finanzinstrumenten besonders hohen Risiken hin. Der Handel mit Optionsscheinen bzw. Derivaten ist ein Finanztermingeschäft. Den erheblichen Chancen stehen entsprechende Risiken bis hin zum Totalverlust gegenüber.

Nur Verbraucher, die gem. § 37d WpHG die bei Banken und Sparkassen ausliegende Broschüre "Basisinformationen über Finanztermingeschäfte" gelesen und verstanden haben sowie das Formular "Wichtige Information über die Verlustrisiken bei Finanztermingeschäften" gelesen und unterschrieben haben sind berechtigt, am Handel mit Options-scheinen und sonstigen Finanztermingeschäften teilzunehmen. Der Kunde handelt gleichwohl auf eigenes Risiko und auf eigene Gefahr.

Haftung für höhere Gewalt

Staud Research haftet nicht für Schäden, die durch höhere Gewalt, Aufruhr, Kriegs- und Naturereignisse oder durch sonstige von ihr nicht zu vertretenden Vorkommnisse (z.B. Streik, Aussperrung, Verkehrsstörung, Verfügungen von hoher Hand im In- oder Ausland) eintreten.

Urheberrecht

Das beigefügte Dokument mit Abbildungen ist urheberrechtlich geschützt. Die dadurch begründeten Rechte, insbesondere des Nachdrucks, der Speicherung in Datenverarbeitungsanlagen sowie das Darstellen auf einer Website liegen, auch bei nur auszugsweiser Verwertung, bei der Staud Research GmbH. Die Weiterleitung, Weiterverbreitung oder Veröffentlichung des StaudReport, auch auszugsweise oder dem Geiste nach, ist grundsätzlich nicht gestattet. Jede Weiterleitung, Weiterverbreitung oder Veröffentlichung des StaudReport, auch auszugsweise, setzt das vorausgegangene Einverständnis der Staud Research GmbH voraus. Alle Rechte vorbehalten.

www.staud-research.de

© Staud Research GmbH