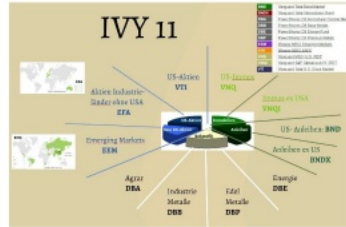


"3 Strategien, die funktionieren"

1. IVY 11: ETFs



- + Nur zwei Regeln
- + 1 Mal pro Monat
- + 4 aus 11
- + Backtests + Positionen

2. Saisonalität: Aktien

Symbol	Name	Code	Current P/E	Market P/E	Current Div. Yield	Market Div. Yield	Current Div. Payout	Market Div. Payout
AAA	AAA	AAA	14.2	14.4	1.81	1.81	12.7%	12.7%
AAA	AAA	AAA	14.2	14.4	1.81	1.81	12.7%	12.7%
AAA	AAA	AAA	14.2	14.4	1.81	1.81	12.7%	12.7%
AAA	AAA	AAA	14.2	14.4	1.81	1.81	12.7%	12.7%
AAA	AAA	AAA	14.2	14.4	1.81	1.81	12.7%	12.7%

- + Rangliste
- + Faktoren: Momentum und Saisonalität
- + Backtests + Positionen

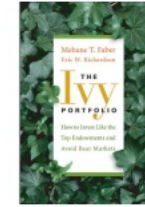
3. Optionen + Aktien



- + Diskretionäres Trading
- + Optionen verkaufen
- + NICHT im Feierabend-Depot



Haftungsausschluss und Copyright:
 Die hier dargestellten Informationen stellen weder ein öffentliches Angebot noch eine Aufforderung zu Angeboten dar. Sie sind ausschließlich zum Zweck der Weiterbildung und Informationsvermittlung für den privaten Gebrauch der Anleger bestimmt. Sie dürfen nicht als Anlageempfehlung oder als Grundlage für Anlageentscheidungen verwendet werden. Die hier dargestellten Informationen sind ausschließlich für den privaten Gebrauch der Anleger bestimmt. Die hier dargestellten Informationen sind ausschließlich für den privaten Gebrauch der Anleger bestimmt. Die hier dargestellten Informationen sind ausschließlich für den privaten Gebrauch der Anleger bestimmt.

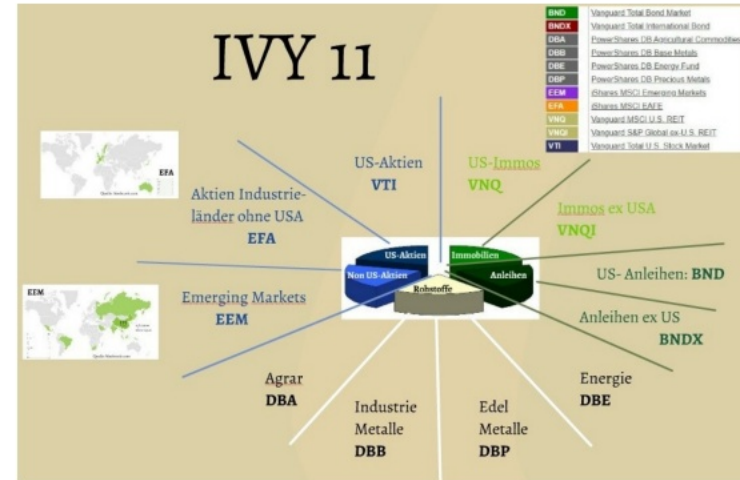


"Ergebnisse wie am Aktienmarkt, aber mit niedrigeren Rückgängen"



QR Code
 Angebot bis 19.7.1. Monat 1 Euro

Gesamtdepot
 Backtest: ca 20% p.a. (inkl 0,6% Gebühr pro Position)



Legend:
 BND: Vanguard Total Bond Market
 BNDX: Vanguard Total International Bond
 CDB: PowerShares DB Commodity Commodity
 CDB: PowerShares DB Energy Fund
 DBE: PowerShares DB Precious Metals
 DBP: PowerShares DB Precious Metals
 DBP: iShares MSCI Emerging Markets
 EEM: iShares MSCI EAFE
 EEM: Vanguard MSCI U.S. REIT
 EEM: Vanguard S&P Global ex-U.S. REIT
 EEM: Vanguard Total U.S. Stock Market

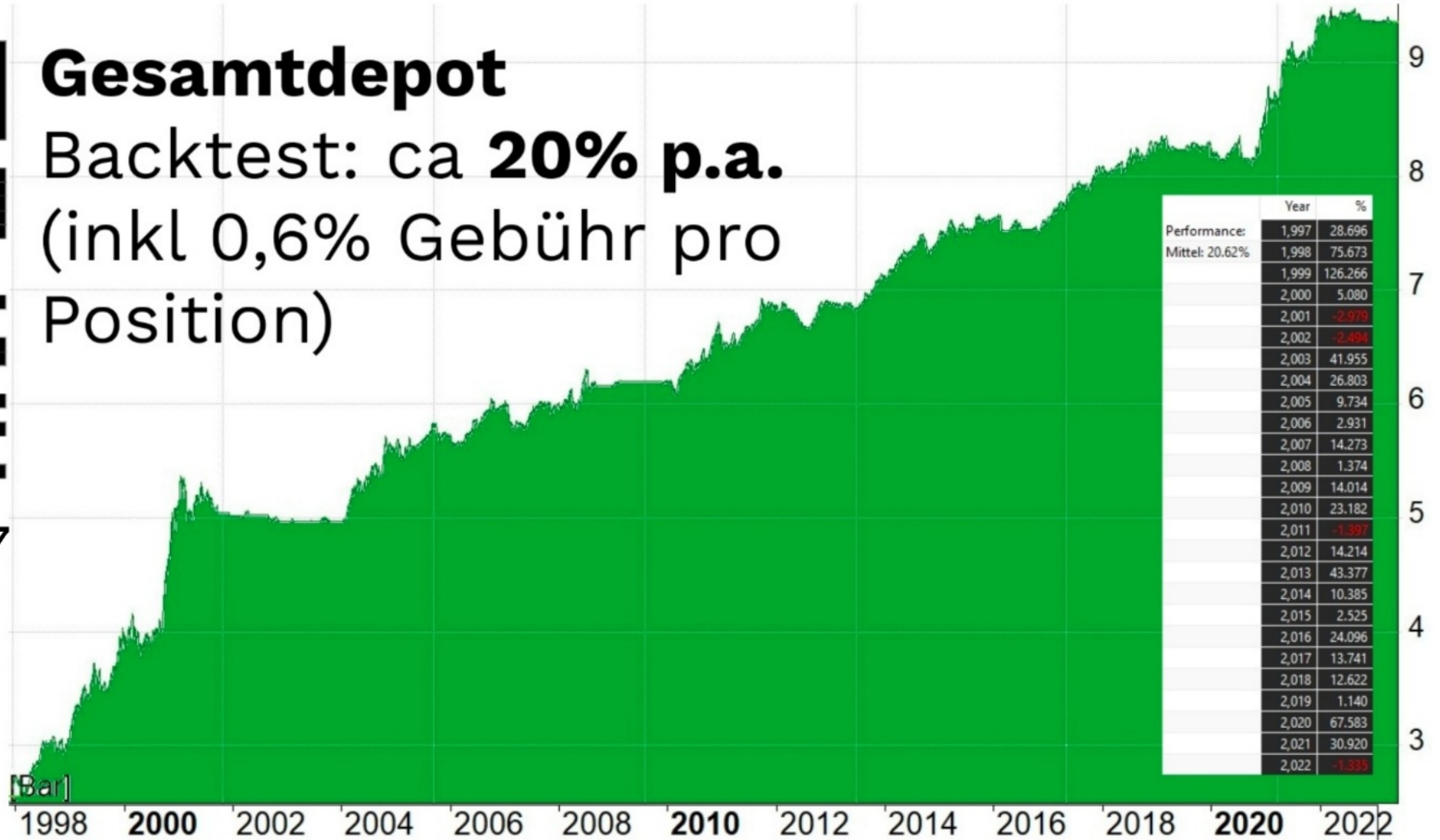
Real gehandelt mit Captrader//
 Für Fortgeschrittene



Angebot bis 19.7
1. Monat 1 Euro

Gesamtdepot

Backtest: ca **20% p.a.**
(inkl 0,6% Gebühr pro
Position)



RISIKOHINWEIS UND HAFTUNGSAUSSCHLUSS

Die bereitgestellten Informationen und Daten dienen ausschließlich Informationszwecken. Es stellt keine Aufforderung zum Kauf oder Verkauf irgendeines Wertpapiers oder eines Derivates dar. Der Kauf von Aktien und Derivaten ist mit hohen Risiken behaftet. Ihre Investitionsentscheidungen sollten Sie nur nach eigener Recherche und nicht basierend auf den hier erlangten Informationen treffen.

Der Herausgeber übernimmt keine Verantwortung für etwaige Verluste, die durch Verwendung seiner Informationen entstehen. Eine Anlageentscheidung hinsichtlich eines Finanzinstruments sollte auf Grundlage eines genehmigten und veröffentlichten Prospektes oder anderer Informationsunterlagen erfolgen und nicht auf Grundlage der hier bereitgestellten Inhalte, die ausschließlich die Einschätzung und Meinung des Herausgebers wiedergeben.

Die dargestellten Inhalte sind keine persönliche Empfehlung zum Kauf oder Verkauf von Finanzinstrumenten. Die hier gezeigten Inhalte stellen kein Angebot zum Abschluss eines Vertrages oder einer Verpflichtung irgendeiner Art dar. Sie stellen auch keinen Ersatz für die persönliche Beratung in Bezug auf den Kauf oder Verkauf eines Finanzinstruments dar. Eine individuelle anleger- und anlagegerechte Beratung in Bezug auf den Kauf oder Verkauf eines Finanzinstruments kann bei Ihrem Bankberater eingeholt werden. Eventuelle Zahlenangaben zur Wertentwicklung beziehen sich auf die Vergangenheit. Die vergangene Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für künftige Ergebnisse und Entwicklungen eines Finanzinstruments. Aussagen zu zukünftigen Entwicklungen beruhen auf reinen Schätzungen und Annahmen und stellen daher Prognosen dar. Die tatsächliche zukünftige Entwicklung kann von dieser abweichen.

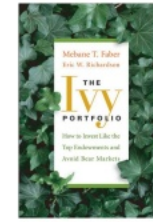
Die in den hier vorliegenden Seiten enthaltenen Analysen basieren auf allgemein zugänglichen Informationen und nicht auf vertraulichen Informationen, die dem Herausgeber zugegangen sind. Der Herausgeber erachtet diese den Prognosen zugrundeliegenden Informationen als zuverlässig, macht jedoch keine Zusicherungen betreffend deren Genauigkeit und Vollständigkeit.

Für die bereitgestellten Handelsanregungen wird keine Haftung übernommen. Die Handelsanregungen oder anderweitige Informationen stellen in keiner Weise einen Aufruf zur individuellen oder allgemeinen Nachbildung, zum Kauf oder Verkauf von Wertpapieren oder derivativen Finanzprodukten, auch nicht stillschweigend, dar. Eine Haftung für mittelbare und unmittelbare Folgen der veröffentlichten Inhalte ist somit ausgeschlossen. Die zugrunde liegenden Analysen berücksichtigen in keiner Weise eine konkrete persönliche Anlagesituation und dürfen folglich nicht als Anlageberatung im Sinne des Paragraph 32 KWG aufgefasst werden.

Hinweis auf mögliche Interessenskonflikte:

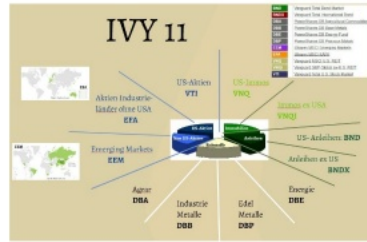
Es besteht die Möglichkeit, dass der Ersteller dieses Videos, verbundene Unternehmen oder aber deren Gesellschafter, Führungskräfte oder Mitarbeiter Anteile oder Positionen an Wertpapieren oder Finanzprodukten halten, die hier diskutiert werden.

"3 Strategien, die funktionieren"



"Ergebnisse wie am Aktienmarkt, aber mit niedrigeren Rückgängen"

1. IVY 11: ETFs



- + Nur zwei Regeln
- + 1 Mal pro Monat
- + 4 aus 11
- + Backtests + Positionen



IVY 5

IVY11

2. Saisonalität: Aktien

Symbol	Value	Change	Carroll-Smith-BIC	Peak Month-BIC	Carroll-Smith Avg BIC	Peak Month Avg BIC
SPY	450.00	4.10	14.00	14.00	0.00	0.00
QQQ	380.00	3.70	13.50	13.50	0.00	0.00
IWM	120.00	1.20	12.00	12.00	0.00	0.00
VTI	100.00	1.00	10.00	10.00	0.00	0.00
EEM	50.00	0.50	5.00	5.00	0.00	0.00
DBA	20.00	0.20	2.00	2.00	0.00	0.00
DBB	15.00	0.15	1.50	1.50	0.00	0.00
DBE	10.00	0.10	1.00	1.00	0.00	0.00
DBP	8.00	0.08	0.80	0.80	0.00	0.00
DBX	6.00	0.06	0.60	0.60	0.00	0.00
DBV	4.00	0.04	0.40	0.40	0.00	0.00
DBW	3.00	0.03	0.30	0.30	0.00	0.00
DBY	2.00	0.02	0.20	0.20	0.00	0.00
DBZ	1.00	0.01	0.10	0.10	0.00	0.00

- + Rangliste
- + Faktoren: Momentum und Saisonalität
- + Backtests + Positionen



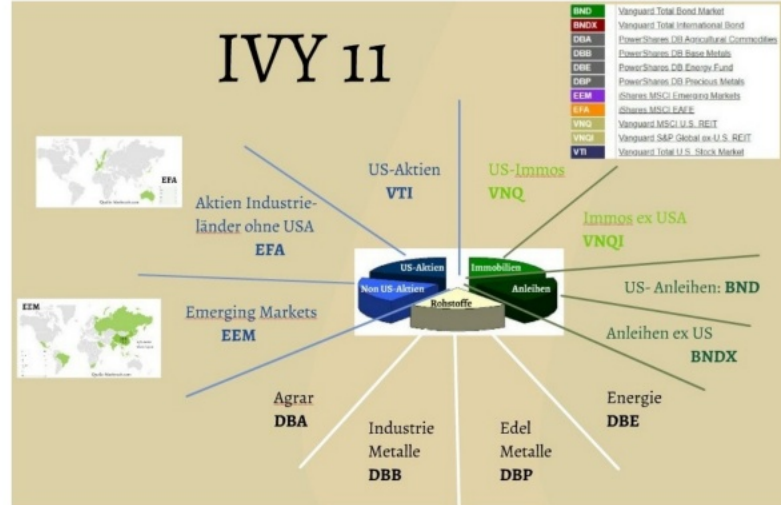
3. Optionen + Aktien



- + Diskretionäres Trading
- + Optionen verkaufen
- + NICHT im Feierabend-Depot



Haftungsausschluss und Copyright:
 Die hier dargestellten Informationen stellen weder ein öffentliches Angebot noch eine Aufforderung zur Abgabe eines Angebotes zum Zweck von Wertpapieren dar. Die Informationen sind nur für den privaten Gebrauch und sind nicht für den Verkauf oder die Abgabe von Wertpapieren bestimmt. Die Informationen sind nicht zu veröffentlichen und dürfen nicht weitergegeben werden. Die Informationen sind nicht zu veröffentlichen und dürfen nicht weitergegeben werden. Die Informationen sind nicht zu veröffentlichen und dürfen nicht weitergegeben werden.



Real gehandelt mit Captrader// Für Fortgeschrittene

Strategie der Universitätsstiftungen Harvard + Yale

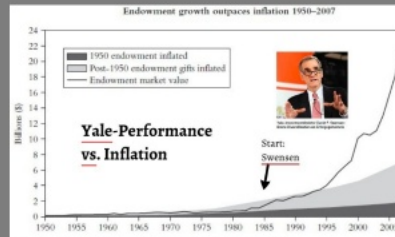
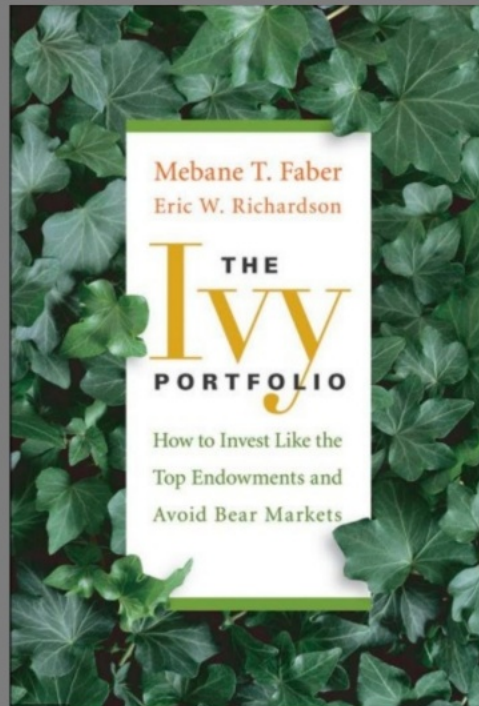


Figure 1.2 Yale Endowment vs. Inflation, 1950-2007
Source: Yale 2007 endowment report. Mit freundl. Genehmigung: Meb Faber

ERGEBNISSE IM VERGLEICH

Strategie	Winn	Verlust	Max. Drawdown
Jhrliche Rendite	11,21	26,62	18,81
Kursstrke	1,92	20,10	18,21
Beste Jahre	22,90	41,00	47,28
Schlechtes Jhr	-2,30	-10,15	6,72
Korrelation zu Yale	22,00	-	78,90
Korrel. zu Harvard	-	-	88,90

Quelle: Meb Faber's Book „The Ivy Portfolio“ 2008

Nur zwei Regeln

---> 2 Regeln, immer nur zum Monatsende angewandt:

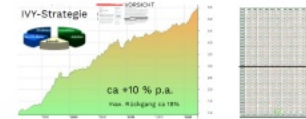
1) Verluste begrenzen



2) Beste Teams/ "Championsleague"



Backtest-Ergebnisse



Aktueller Stand: 1.7.23
US Aktien, Aktien EU , Anleihen



Trend der letzten 10 Monate entscheidet

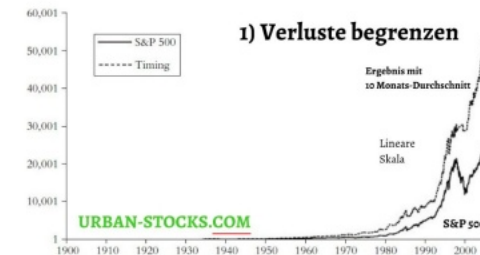
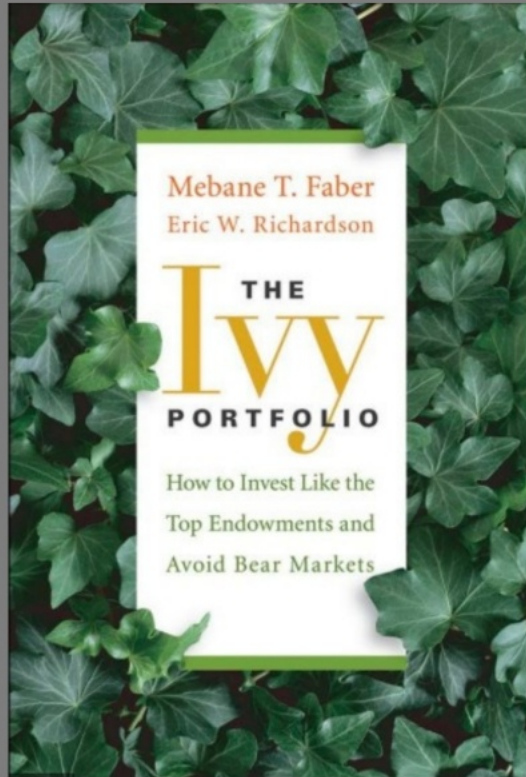


Figure 7.3 S&P 500 Performance from 1900 to 2008

Strategie der Universitätsstiftungen Harvard + Yale



Buchautor Meb Faber: „Wenn du merkst, dass du ein totes Pferd reitest, steig ab“

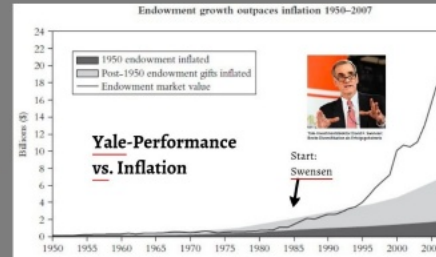


Figure 1.2 Yale Endowment vs. Inflation, 1950-2007
Source: Yale 2007 endowment report.
Mit freundl. Genehmigung: Meb Faber

ERGEBNISSE IM VERGLEICH

	Yale	Harvard	Yale	Harvard
Jährliche Rendite	15,25	10,62	10,81	10,81
Volatilität	5,50	10,40	10,21	10,21
Bestes Jahr	32,20	41,50	47,19	47,19
Schlechtes Jahr	-2,70	-4,20	-3,72	-3,72
Korrelation zu Yale	51,00	-	79,00	-
Korrel. zu Harvard	-	91,50	82,00	-

Quelle: Meb Faber's Buch, 'The Ivy Portfolio', 2008

Mit seiner etwas vereinfachten Methode erreicht Meb Faber langfristig eine Performance, die sich etwas in der Mitte zwischen Yale und Harvard orientiert. Im besten und im schlechtesten Jahr hängt sie die Endowmenten sogar ab.

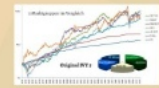
Nur zwei Regeln

---> 2 Regeln, immer nur zum Monatsende angewandt:

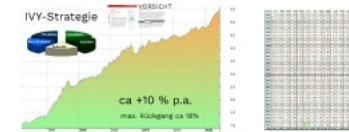
1) Verluste begrenzen



2) Beste Teams/ "Championsleague"



Backtest-Ergebnisse



Aktueller Stand: 1.7.23
US Aktien, Aktien EU , Anleihen



Trend der letzten 10 Monate entscheidet

2) Kaufe Stärke!

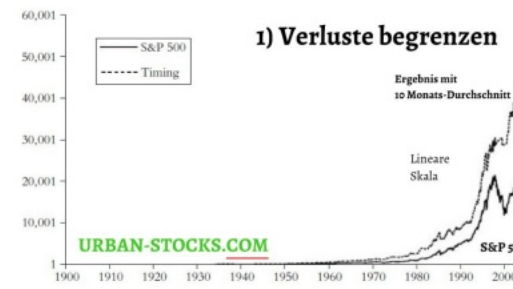
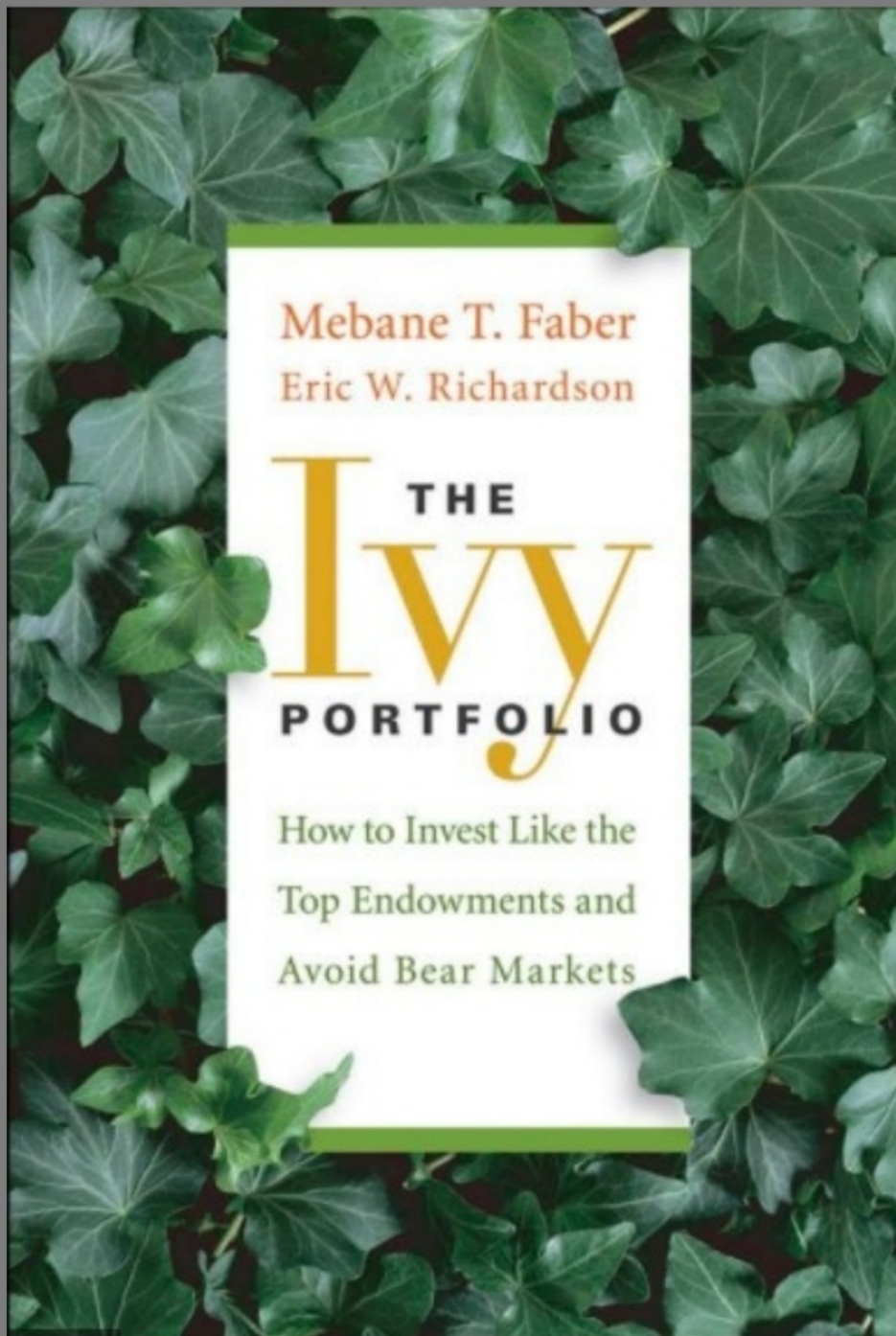


Figure 7.3 S&P 500 Performance from 1900 to 2008



Mebane T. Faber
Eric W. Richardson

THE IVY PORTFOLIO

How to Invest Like the
Top Endowments and
Avoid Bear Markets



Buchautor Meb Faber: „Wenn du merkst, dass du ein totes Pferd reitest, steig ab“

BÖRSE ONLINE 42 2018
18.10. - 24.10.2018

Knorr-Bremse 80 ► So machte Patriarch Thiele den Konzern fit für die Börse

18 ► Zucker
Innovative Technik gegen Diabetes

34 ► Zocker
Reifenhändler liefert jetzt Lebensmittel

76 ► Zuschuss
Alles zum neuen Baukindergeld

Die Elite Strategie

Verluste klein halten, Gewinne maximieren: Die Erfolgsformel der Universität Yale lässt sich leicht nachbilden

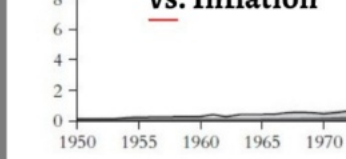


Figure 1.2 Yale Endowment vs. I
SOURCE: Yale 2007 endowment report.

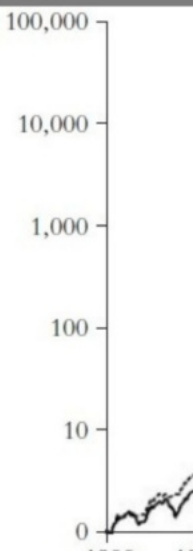
Nu

---> 2 Reg

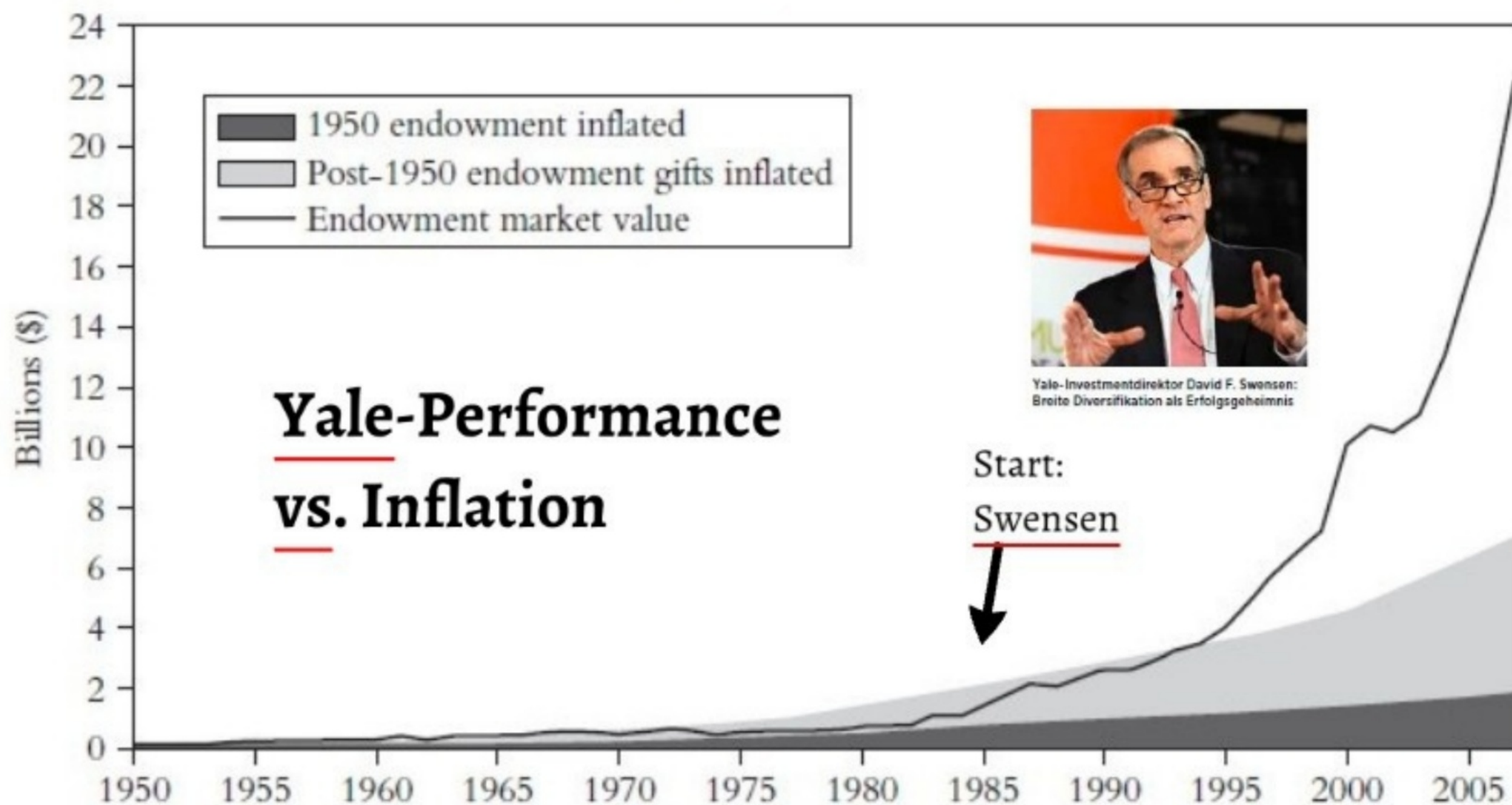
1) Verlu



2) Best



Endowment growth outpaces inflation 1950–2007



Yale-Investmentdirektor David F. Swensen: Breite Diversifikation als Erfolgsgeheimnis

Figure 1.2 Yale Endowment vs. Inflation, 1950–2007

SOURCE: Yale 2007 endowment report.

Mit freundl. Genehmigung: Meb Faber

ERGEBNI

Jährliche Re

Volatilität

Bestes Jahr

Schlechteste

Korrelation

Korrel. zu H

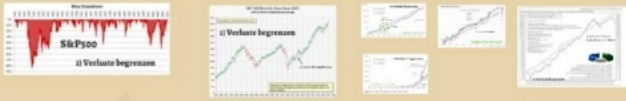
Quelle: Meb

Mit seiner
erreicht **M**
Performan
zwischen Y
Im besten
hängte sie

Nur zwei Regeln

---> 2 Regeln, immer nur zum **Monatsende** angewandt:

1) Verluste begrenzen



2) Beste Teams/ "Championsleague"



Trend der letzten 10 Monate entscheidet

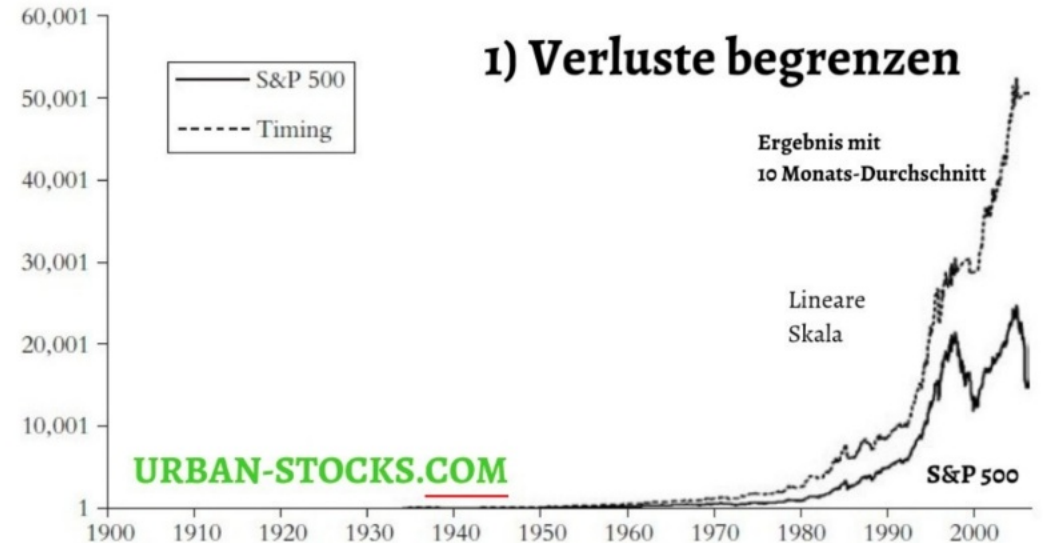
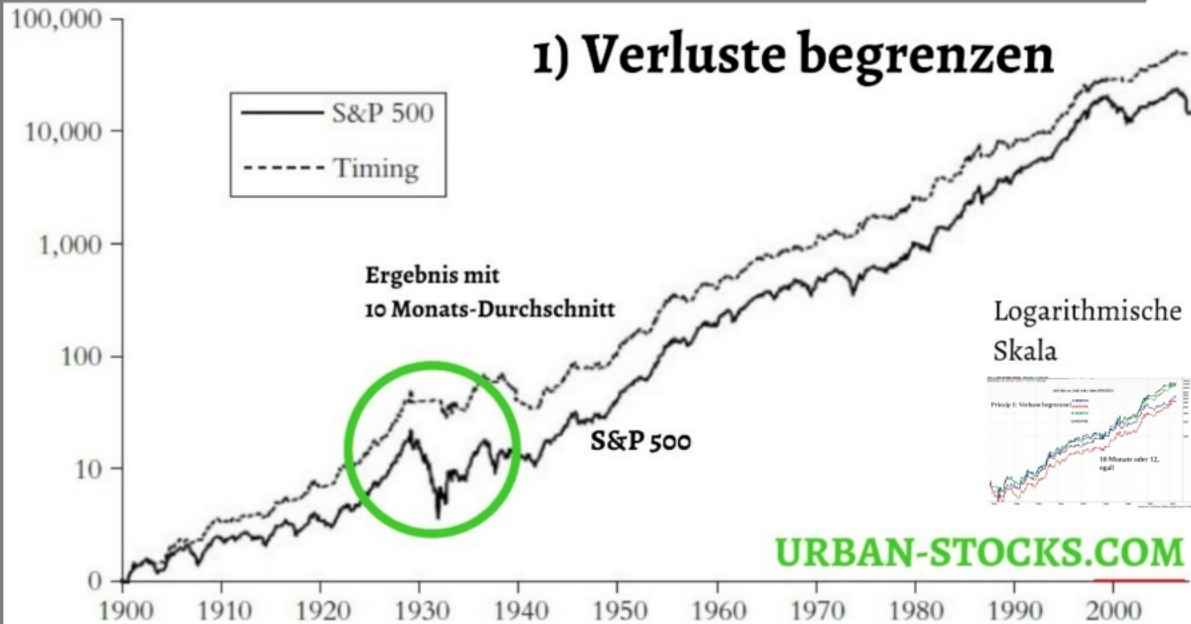
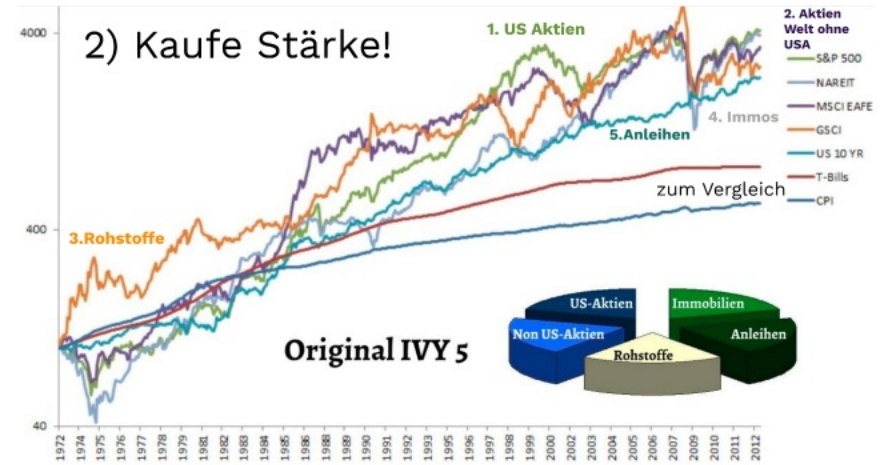
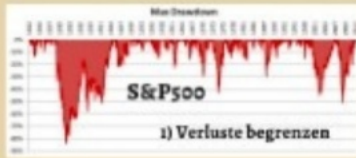


Figure 7.3 S&P 500 Performance from 1900 to 2008

Nur zwei Regeln

---> 2 Regeln, immer nur zum **Monatsende** angewandt:

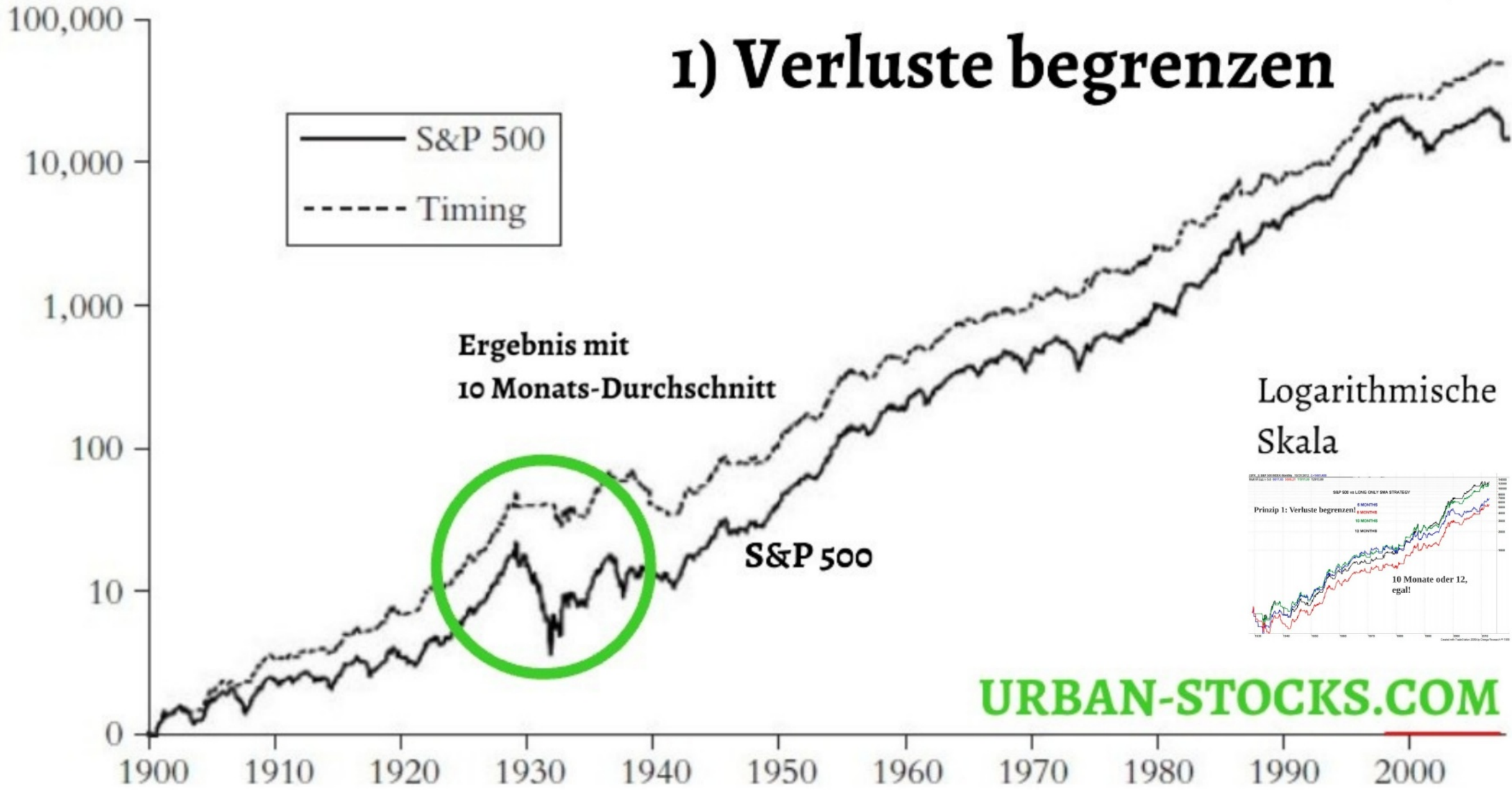
1) Verluste begrenzen



2) Beste Teams/ "Championsleague"



1) Verluste begrenzen



Logarithmische Skala



URBAN-STOCKS.COM

1) Verluste begrenzen

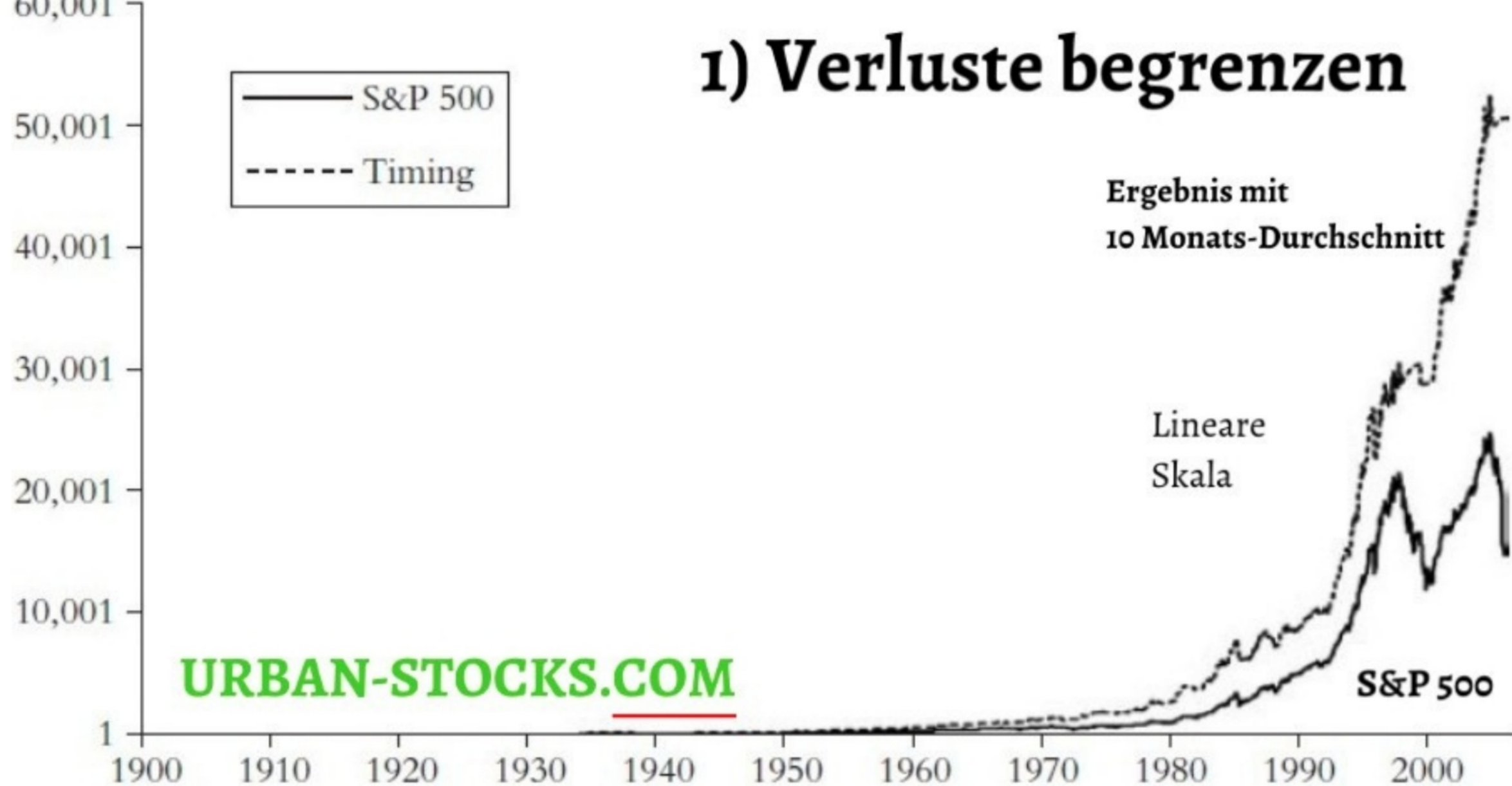


Figure 7.3 S&P 500 Performance from 1900 to 2008

S&P 500 vs LONG ONLY SMA STRATEGY

Prinzip 1: Verluste begrenzen!

6 MONTHS

8 MONTHS

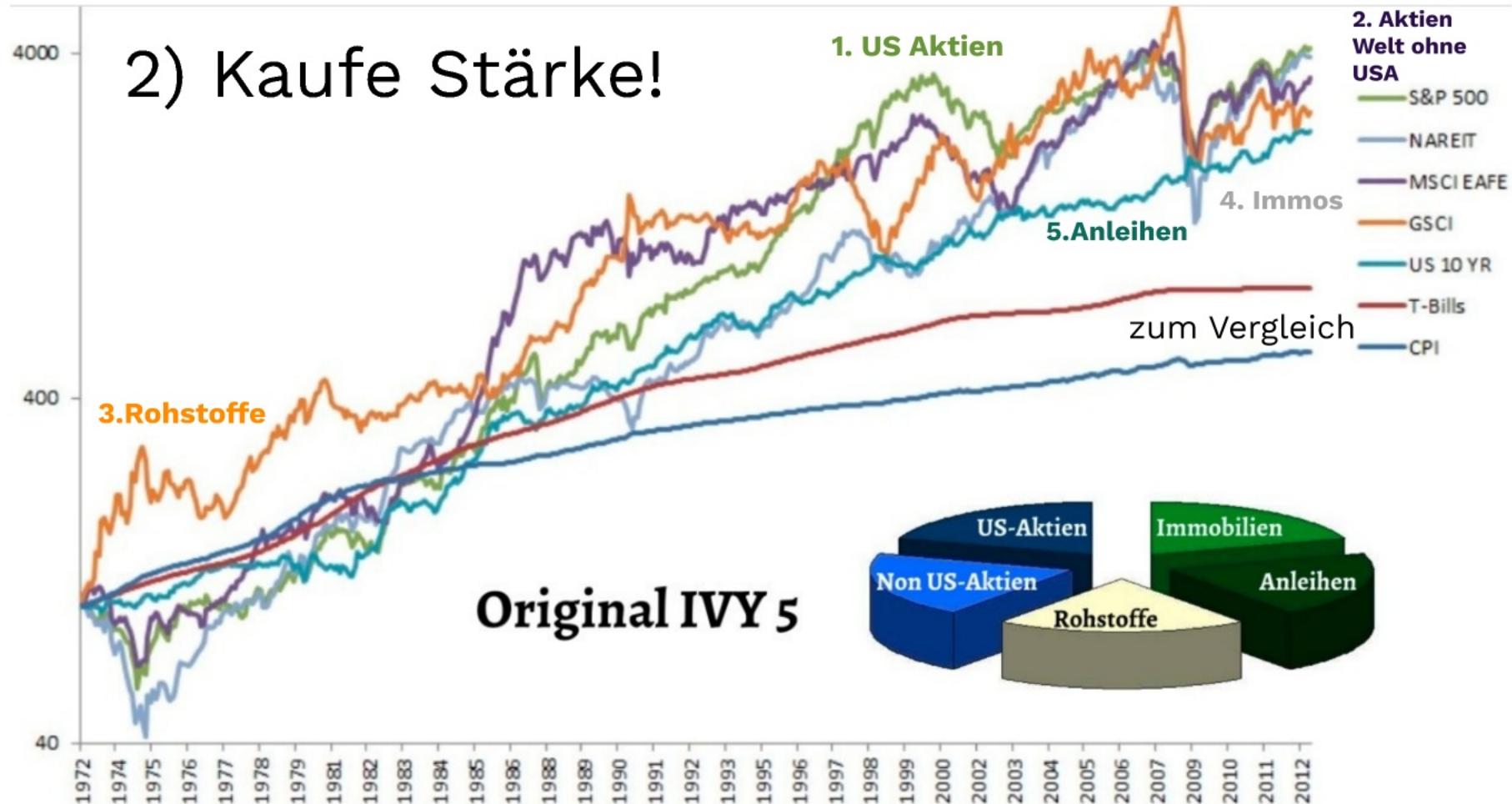
10 MONTHS

12 MONTHS

**10 Monate oder 12,
egal!**



Trend der letzten 10 Monate entscheidet



Backtest-Ergebnisse

IVY-Strategie



VORSICHT

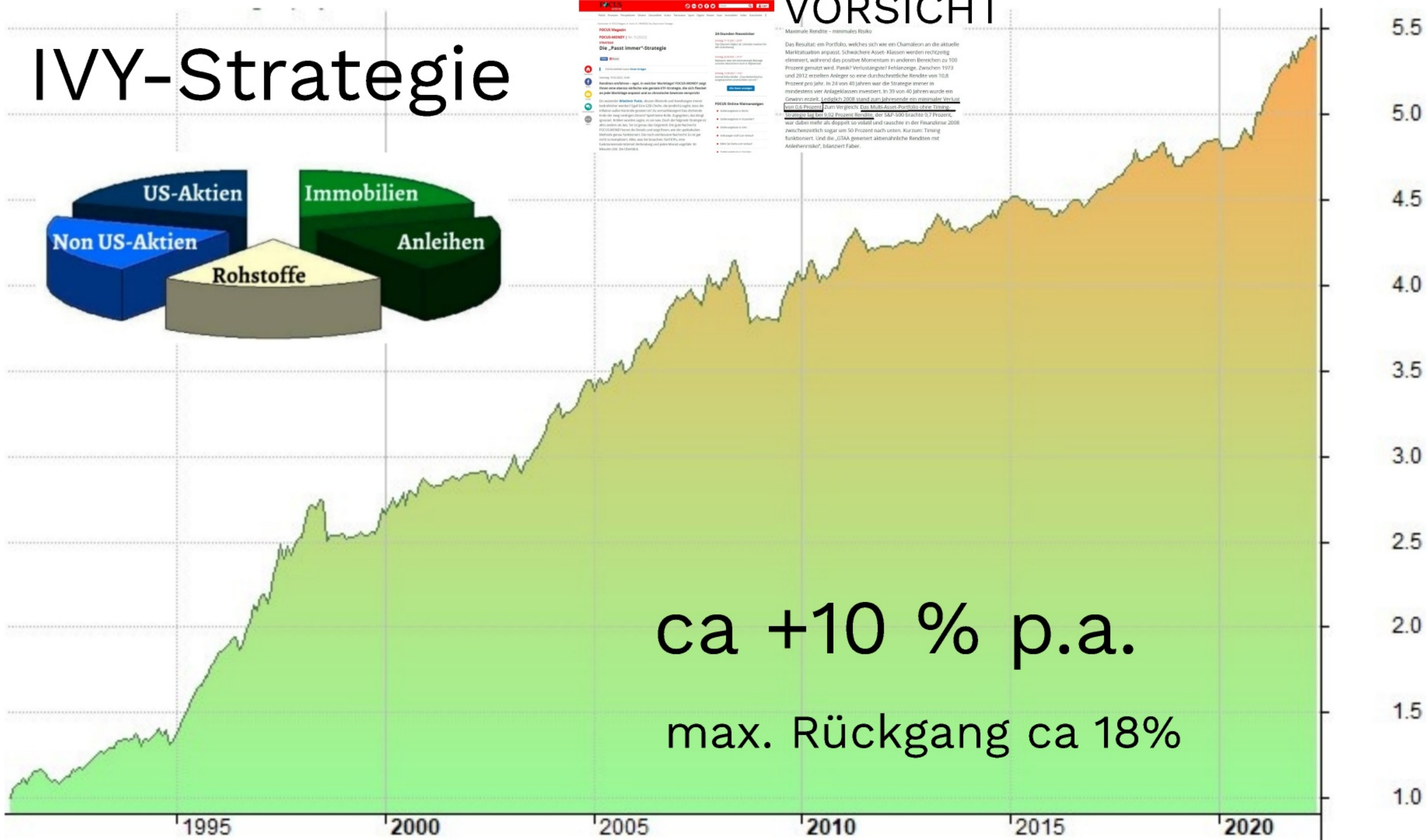
Das Diagramm zeigt die Performance der IVY-Strategie von 1991 bis 2023. Die Y-Achse stellt den Wertindex dar, der von 1.0 bis 5.5 reicht. Die X-Achse zeigt die Jahre von 1995 bis 2020. Die Performance ist als Fläche unter einer Linie dargestellt, die den Wertindex über die Zeit darstellt. Die Fläche ist in verschiedene Farben unterteilt, die die verschiedenen Komponenten der Strategie repräsentieren: US-Aktien (blau), Non US-Aktien (dunkelblau), Rohstoffe (grün), Immobilien (hellgrün) und Anleihen (dunkelgrün). Die Performance zeigt eine allgemeine Aufwärtsbewegung mit einem signifikanten Rückgang im Jahr 2008.

ca +10 % p.a.
max. Rückgang ca 18%

5.5
5.0
4.5
4.0
3.5
3.0
2.5
2.0
1.5
1.0

Year	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	Yr%
1991	N/A	2.6%	0.8%	0.6%	1.7%	-1.7%	2.0%	2.0%	0.2%	1.7%	-2.4%	-1.3%	6.1%
1992	-1.1%	0.6%	-0.8%	1.1%	1.5%	-0.2%	1.7%	-0.3%	1.2%	-1.0%	1.1%	0.9%	4.8%
1993	0.9%	1.0%	1.4%	2.1%	0.8%	0.8%	1.3%	3.4%	-1.0%	1.4%	-3.2%	0.5%	9.7%
1994	4.3%	-1.7%	-3.2%	1.0%	0.3%	1.2%	0.9%	-0.2%	-1.7%	1.6%	-3.0%	-0.1%	-1.0%
1995	1.4%	2.0%	1.2%	1.3%	2.2%	0.6%	1.9%	1.1%	2.0%	0.6%	2.9%	4.1%	23.3%
1996	1.5%	1.1%	2.2%	3.5%	0.3%	1.5%	-4.3%	1.9%	3.7%	0.5%	6.1%	-0.9%	18.1%
1997	1.9%	-2.0%	-2.0%	3.5%	2.9%	1.3%	4.5%	-4.7%	3.5%	-3.1%	0.0%	1.2%	6.8%
1998	1.0%	3.4%	3.3%	0.7%	-0.8%	2.2%	-0.5%	-9.1%	0.8%	-0.1%	2.0%	3.0%	5.2%
1999	1.8%	-2.5%	2.9%	3.2%	-1.2%	1.5%	-1.3%	-0.2%	0.8%	-0.4%	3.6%	6.4%	15.3%
2000	-1.9%	2.8%	3.4%	-3.5%	1.9%	3.6%	-4.6%	6.1%	-1.0%	-1.2%	5.0%	2.0%	12.6%
2001	-1.6%	-0.8%	-0.9%	0.5%	-0.0%	2.2%	-0.1%	1.7%	-0.9%	-0.2%	1.3%	0.5%	1.5%
2002	0.2%	0.9%	0.0%	-0.3%	1.1%	0.1%	-4.3%	2.4%	0.4%	-1.7%	-0.3%	3.1%	1.6%
2003	2.6%	4.3%	-5.0%	-1.9%	4.4%	0.3%	2.6%	1.7%	0.9%	3.4%	2.4%	5.3%	22.5%
2004	2.8%	1.7%	2.9%	-5.6%	1.9%	0.0%	1.3%	1.9%	4.0%	4.4%	1.9%	-0.1%	18.0%
2005	-4.5%	4.6%	0.6%	-2.1%	1.0%	2.4%	5.3%	-0.9%	1.9%	-4.9%	1.6%	1.7%	6.3%
2006	6.3%	0.6%	3.2%	0.6%	-3.4%	2.3%	1.7%	3.0%	1.4%	4.6%	3.5%	0.7%	27.2%
2007	4.1%	-1.2%	0.1%	2.5%	1.7%	-3.8%	-0.5%	-2.0%	6.5%	5.6%	-4.2%	1.4%	9.9%
2008	-2.9%	4.6%	-0.3%	2.8%	3.8%	0.9%	-5.8%	-3.0%	-5.2%	-10.0%	1.4%	1.0%	-13.0%
2009	-0.9%	-0.2%	0.6%	-0.5%	-0.4%	-0.5%	5.6%	6.8%	5.0%	-2.6%	5.2%	3.7%	23.7%
2010	-4.5%	2.8%	7.7%	2.8%	-4.7%	-3.0%	3.6%	-1.4%	1.7%	2.9%	-1.0%	6.6%	13.4%
2011	2.2%	3.9%	0.9%	3.7%	-2.3%	-3.2%	0.5%	-4.0%	0.5%	-0.2%	-1.8%	0.2%	0.0%
2012	1.9%	0.9%	2.5%	0.9%	-3.0%	3.2%	1.6%	0.7%	-0.1%	-0.9%	0.9%	2.4%	11.3%
2013	2.9%	0.7%	2.1%	4.0%	-2.0%	-2.7%	1.8%	-3.9%	-0.1%	2.2%	-0.4%	1.2%	5.9%
2014	-3.2%	3.3%	0.4%	0.7%	2.3%	1.7%	-0.9%	2.7%	-3.7%	3.8%	2.0%	0.3%	9.2%
2015	1.2%	1.0%	-0.2%	-1.3%	0.3%	-1.9%	0.8%	-2.6%	0.3%	-0.2%	-0.1%	-0.1%	-2.9%
2016	-2.8%	0.1%	3.4%	-0.5%	1.4%	3.1%	2.6%	-1.2%	-0.5%	-2.8%	1.2%	2.2%	5.9%
2017	1.3%	1.9%	0.2%	1.1%	1.3%	0.2%	2.3%	0.4%	1.0%	1.5%	2.2%	1.0%	15.2%
2018	4.9%	-3.9%	-0.2%	1.4%	0.4%	2.0%	0.4%	2.4%	0.6%	-5.2%	1.4%	-5.0%	-1.4%
2019	0.1%	0.0%	2.7%	1.1%	-1.1%	0.7%	1.0%	2.0%	0.9%	1.0%	0.7%	0.9%	10.5%
2020	-0.5%	-4.3%	0.9%	0.2%	-0.1%	0.7%	2.2%	3.5%	-2.0%	-1.9%	7.9%	3.9%	10.3%
2021	-0.5%	5.0%	1.2%	5.5%	1.1%	2.8%	2.7%	0.9%	-1.5%	6.6%	-4.4%	7.0%	29.2%
2022	-0.5%	1.1%	3.7%	-1.3%	2.3%	-3.5%	-0.0%	-1.2%	-3.4%	0.0%	-0.1%	-1.9%	-4.8%
2023	-0.2%	-2.6%	1.7%	1.1%	-1.4%	3.4%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	2.0%
Avg	0.6%	1.0%	1.1%	0.9%	0.4%	0.6%	0.8%	0.3%	0.5%	0.2%	1.0%	1.6%	

IVY-Strategie



FOCUS Magazin

FOCUS-MONEY | Nr. 9 (2022)

STRATEGIE

Die „Passt immer“-Strategie

Teilen Pocket

FOCUS-MONEY-Autor **Sinan Krieger**

Samstag, 19.02.2022, 10:40

Renditen einfahren – egal, in welcher Marktlage? FOCUS-MONEY zeigt Ihnen eine ebenso einfache wie geniale ETF-Strategie, die sich flexibel an jede Marktlage anpasst und so chronische Gewinne verspricht

Ein wütender **Wladimir Putin**, dessen Rhetorik und Handlungen immer bedrohlicher werden? Egal! Eine EZB-Chefin, die (endlich) zugibt, dass die Inflation außer Kontrolle geraten ist? Zu vernachlässigen! Das drohende Ende der ewig niedrigen Zinsen? Spielt keine Rolle. Zugegeben, das klingt Ignorant. Kritiker würden sagen, es sei naiv. Doch die folgende Strategie ist alles andere als das. Sie ist genau das Gegenteil. Die gute Nachricht: FOCUS-MONEY kennt die Details und zeigt Ihnen, wie die spektakuläre Methode genau funktioniert. Die noch viel bessere Nachricht: Es ist gar nicht so kompliziert. Alles, was Sie brauchen: fünf ETFs, eine funktionierende Internet-Verbindung und jeden Monat ungefähr 30 Minuten Zeit. Ein Überblick.

24-Stunden Newsticker

Sonntag, 17.10.2021 | 20:57
Top-Ökonom Stiglitz rät: Schulden machen für den Aufschwung

Sonntag, 22.08.2021 | 10:17
Markwort über die internationale Blamage und den deutschen Irrtum in Afghanistan

Samstag, 12.06.2021 | 14:21
Konrad Rufus Müller: „Frau Merkel fand es ausgesprochen unverschämt von mir“

Alle News anzeigen

FOCUS Online Kleinanzeigen

- Stellenangebote in Berlin
- Stellenangebote in Düsseldorf
- Stellenangebote in Köln
- Volkswagen Golf zum Verkauf
- BMW 3er Reihe zum Verkauf
- Stellenangebote in Dresden

VORSICHT

Maximale Rendite – minimales Risiko

Das Resultat: ein Portfolio, welches sich wie ein Chamäleon an die aktuelle Marktsituation anpasst. Schwächere Asset-Klassen werden rechtzeitig eliminiert, während das positive Momentum in anderen Bereichen zu 100 Prozent genutzt wird. Panik? Verlustängste? Fehlanzeige. Zwischen 1973 und 2012 erzielten Anleger so eine durchschnittliche Rendite von 10,8 Prozent pro Jahr. In 24 von 40 Jahren war die Strategie immer in mindestens vier Anlageklassen investiert. In 39 von 40 Jahren wurde ein Gewinn erzielt. Lediglich 2008 stand zum Jahresende ein minimaler Verlust von 0,6 Prozent. Zum Vergleich: Das Multi-Asset-Portfolio ohne Timing-Strategie lag bei 9,92 Prozent Rendite, der S&P-500 brachte 9,7 Prozent, war dabei mehr als doppelt so volatil und rauschte in der Finanzkrise 2008 zwischenzeitlich sogar um 50 Prozent nach unten. Kurzum: Timing funktioniert. Und die „GTAA generiert aktienähnliche Renditen mit Anleihenrisiko“, bilanziert Faber.





Startseite



Teilen



E-Mail



Kommentare



Mehr

FOCUS-MONEY-Autor [Sinan Krieger](#)

Samstag, 19.02.2022, 10:40

Renditen einfahren – egal, in welcher Marktlage? FOCUS-MONEY zeigt Ihnen eine ebenso einfache wie geniale ETF-Strategie, die sich flexibel an jede Marktlage anpasst und so chronische Gewinne verspricht

Ein wütender [Wladimir Putin](#), dessen Rhetorik und Handlungen immer bedrohlicher werden? Egal! Eine EZB-Chefin, die (endlich) zugibt, dass die Inflation außer Kontrolle geraten ist? Zu vernachlässigen! Das drohende Ende der ewig niedrigen Zinsen? Spielt keine Rolle. Zugegeben, das klingt ignorant. Kritiker würden sagen, es sei naiv. Doch die folgende Strategie ist alles andere als das. Sie ist genau das Gegenteil. Die gute Nachricht: FOCUS-MONEY kennt die Details und zeigt Ihnen, wie die spektakuläre Methode genau funktioniert. Die noch viel bessere Nachricht: Es ist gar nicht so kompliziert. Alles, was Sie brauchen: fünf ETFs, eine funktionierende Internet-Verbindung und jeden Monat ungefähr 30 Minuten Zeit. Ein Überblick.

und den deut

Samstag, 12.06

Konrad Rufus
ausgesproche

FOCUS O

● Stellenar

● Stellenar

● Stellenar

● Volkswag

● BMW 3e

● Stellenar

Prozent genutzt wird. Panik? Verlustängste? Ferienanzeige. Zwischen 1973 und 2012 erzielten Anleger so eine durchschnittliche Rendite von 10,8 Prozent pro Jahr. In 24 von 40 Jahren war die Strategie immer in mindestens vier Anlageklassen investiert. In 39 von 40 Jahren wurde ein Gewinn erzielt. Lediglich 2008 stand zum Jahresende ein minimaler Verlust von 0,6 Prozent. Zum Vergleich: Das Multi-Asset-Portfolio ohne Timing-Strategie lag bei 9,92 Prozent Rendite, der S&P-500 brachte 9,7 Prozent, war dabei mehr als doppelt so volatil und rauschte in der Finanzkrise 2008 zwischenzeitlich sogar um 50 Prozent nach unten. Kurzum: Timing funktioniert. Und die „GTAA generiert aktienähnliche Renditen mit Anleihenrisiko“, bilanziert Faber.

VORSICHT

Maximale Rendite – minimales Risiko

Das Resultat: ein Portfolio, welches sich wie ein Chamäleon an die aktuelle Marktsituation anpasst. Schwächere Asset- Klassen werden rechtzeitig eliminiert, während das positive Momentum in anderen Bereichen zu 100 Prozent genutzt wird. Panik? Verlustängste? Fehlanzeige. Zwischen 1973 und 2012 erzielten Anleger so eine durchschnittliche Rendite von 10,8 Prozent pro Jahr. In 24 von 40 Jahren war die Strategie immer in mindestens vier Anlageklassen investiert. In 39 von 40 Jahren wurde ein Gewinn erzielt. Lediglich 2008 stand zum Jahresende ein minimaler Verlust von 0,6 Prozent. Zum Vergleich: Das Multi-Asset-Portfolio ohne Timing-Strategie lag bei 9,92 Prozent Rendite, der S&P-500 brachte 9,7 Prozent, war dabei mehr als doppelt so volatil und rauschte in der Finanzkrise 2008 zwischenzeitlich sogar um 50 Prozent nach unten. Kurzum: Timing funktioniert. Und die „GTAA generiert aktienähnliche Renditen mit Anleihenrisiko“, bilanziert Faber.

FOCUS Magazin

FOCUS-MONEY | Nr. 9 (2022)

STRATEGIE

Die „Passt immer“-Strategie

Teilen Pocket

FOCUS-MONEY-Autor [Sinan Krieger](#)

Samstag, 19.02.2022, 10:40

Renditen einfahren – egal, in welcher Marktlage? FOCUS-MONEY zeigt Ihnen eine ebenso einfache wie geniale ETF-Strategie, die sich flexibel an jede Marktlage anpasst und so chronische Gewinne verspricht

Ein wütender [Wladimir Putin](#), dessen Rhetorik und Handlungen immer bedrohlicher werden? Egal! Eine EZB-Chefin, die (endlich) zugibt, dass die Inflation außer Kontrolle geraten ist? Zu vernachlässigen! Das drohende Ende der ewig niedrigen Zinsen? Spielt keine Rolle. Zugegeben, das klingt Ignorant. Kritiker würden sagen, es sei naiv. Doch die folgende Strategie ist alles andere als das. Sie ist genau das Gegenteil. Die gute Nachricht: FOCUS-MONEY kennt die Details und zeigt Ihnen, wie die spektakuläre Methode genau funktioniert. Die noch viel bessere Nachricht: Es ist gar nicht so kompliziert. Alles, was Sie brauchen: fünf ETFs, eine funktionierende Internet-Verbindung und jeden Monat ungefähr 30 Minuten Zeit. Ein Überblick.

24-Stunden Newsticker

Sonntag, 17.10.2021 | 20:57
Top-Ökonom Stiglitz rät: Schulden machen für den Aufschwung

Sonntag, 22.08.2021 | 10:17
Markwort über die internationale Blamage und den deutschen Irrtum in Afghanistan

Samstag, 12.06.2021 | 14:21
Konrad Rufus Müller: „Frau Merkel fand es ausgesprochen unverschämt von mir“

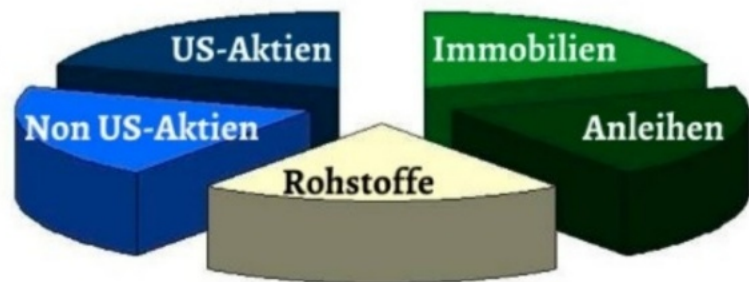
Alle News anzeigen

FOCUS Online Kleinanzeigen

- Stellenangebote in Berlin
- Stellenangebote in Düsseldorf
- Stellenangebote in Köln
- Volkswagen Golf zum Verkauf
- BMW 3er Reihe zum Verkauf
- Stellenangebote in Dresden



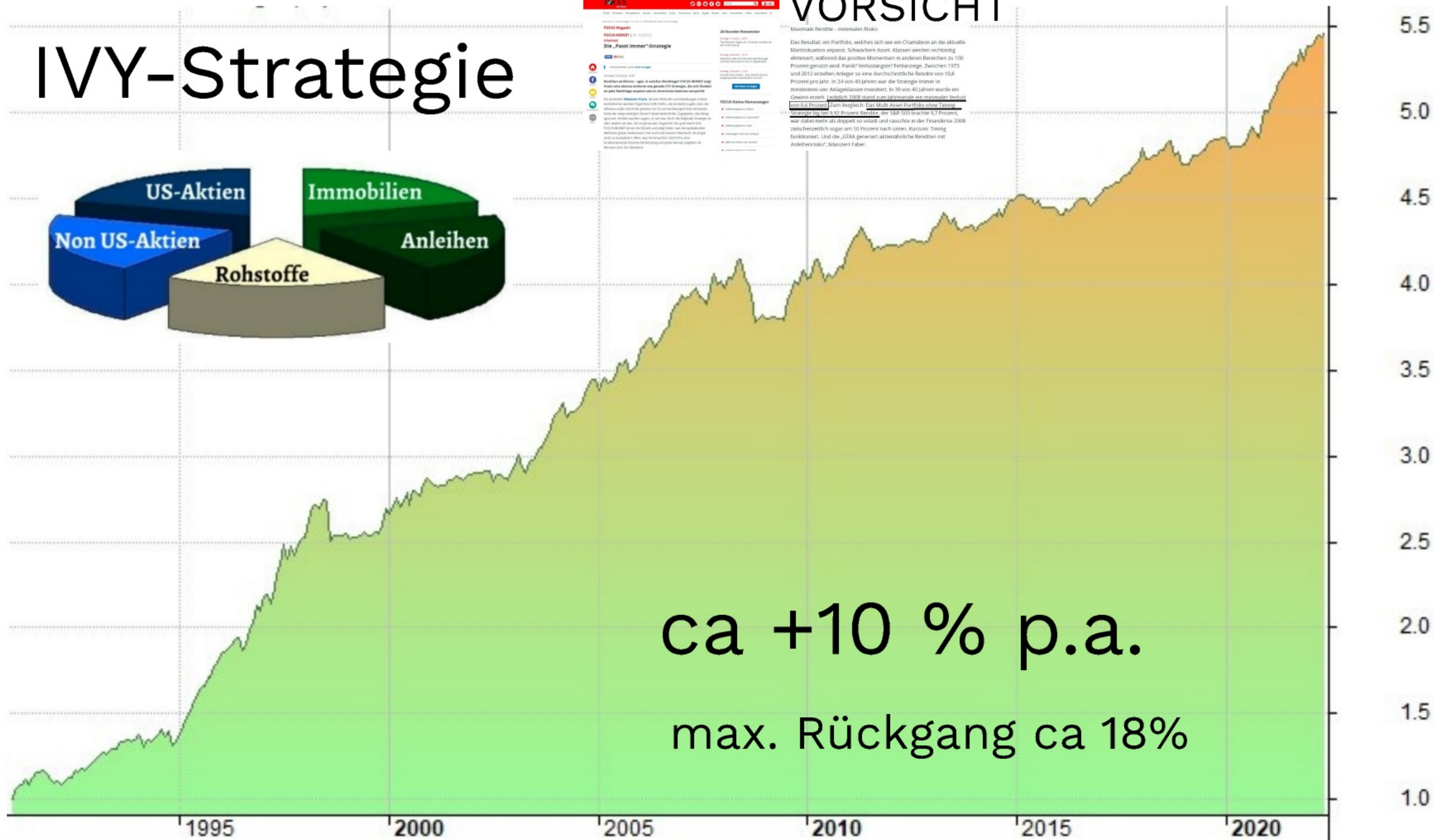
IVY-Strategie



VORSICHT

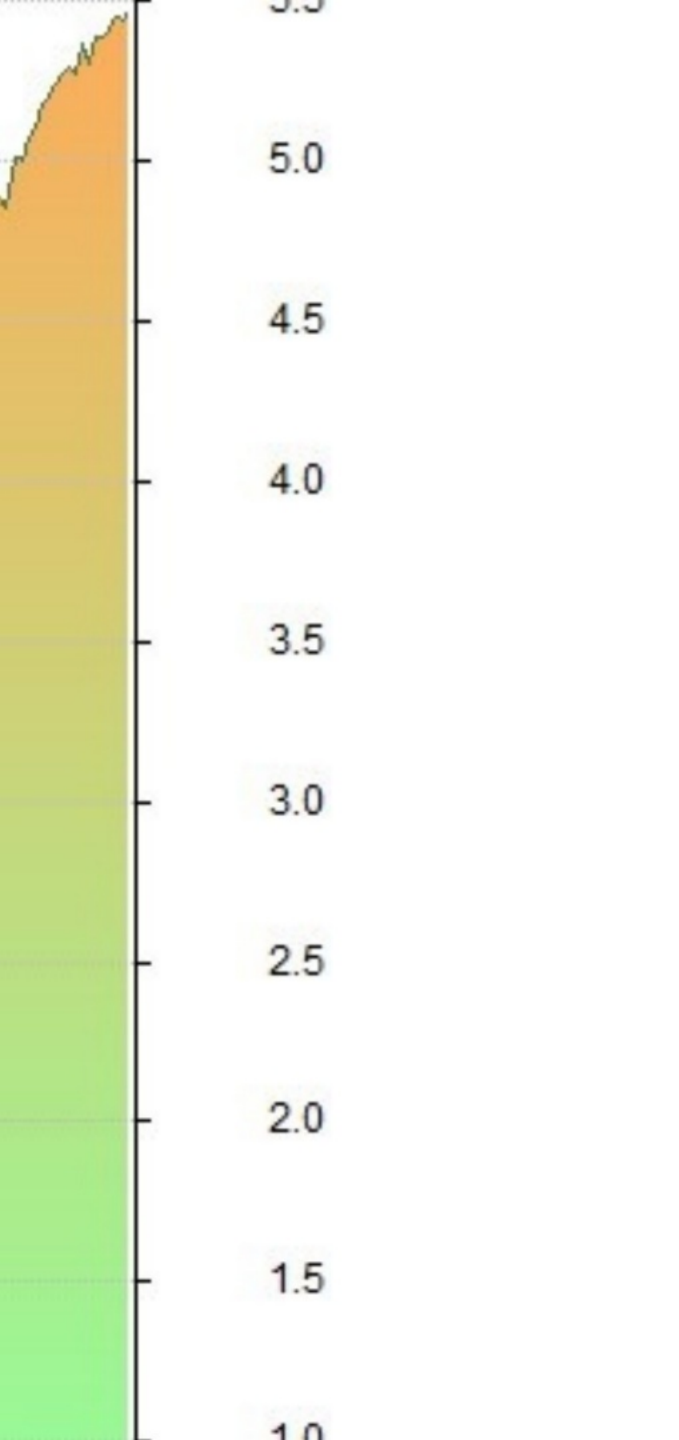
Maximale Rendite - minimales Risiko

Das Resultat: ein Portfolio, welches sich wie ein Chamäleon an die aktuelle Marktsituation anpasst. Schwächere Asset-Klassen werden rechtzeitig eliminiert, während das positive Momentum in anderen Bereichen zu 100 Prozent genutzt wird. Fällt Verlustängste? Fehlansätze. Zwischen 1973 und 2013 erzielten Anleger so eine durchschnittliche Rendite von 10,8 Prozent pro Jahr. In 24 von 40 Jahren war die Strategie immer in mindestens vier Anlageklassen investiert. In 39 von 40 Jahren wurde ein Gewinn erzielt. Lediglich 2008 fiel zum Jahresende ein minimaler Verlust von 0,6 Prozent. Zum Vergleich: Das Multi Asset Portfolio ohne Leverage erzielte im Jahr 2008 eine Rendite von -18,7 Prozent, die S&P 500 brachte 5,7 Prozent, was über 1000 Aktienkurse in Verlust und rauschte in der Finanzkrise 2008 zwischenzeitlich sogar um 50 Prozent nach unten. Kurzum: Timing funktioniert. Und die „GTA“ generiert alternanzfähige Renditen mit „Anleihenrisiko“, bilanziert Faber.



ca +10 % p.a.

max. Rückgang ca 18%



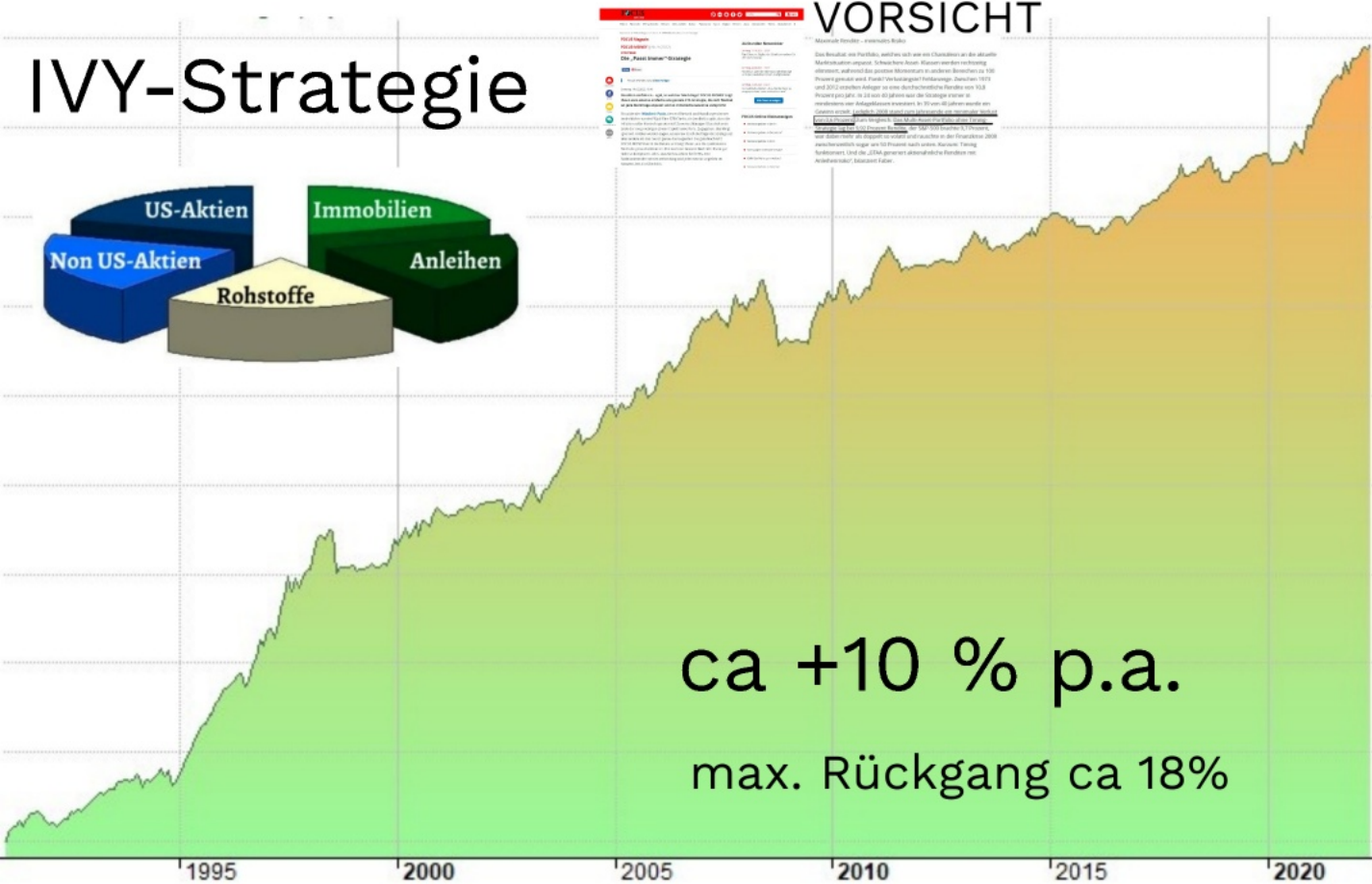
Year	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	Yr%
1991	N/A	2.6%	0.8%	0.6%	1.7%	-1.7%	2.0%	2.0%	0.2%	1.7%	-2.4%	-1.3%	6.1%
1992	-1.1%	0.6%	-0.8%	1.1%	1.5%	-0.2%	1.7%	-0.3%	1.2%	-1.0%	1.1%	0.9%	4.8%
1993	0.9%	1.0%	1.4%	2.1%	0.8%	0.8%	1.3%	3.4%	-1.0%	1.4%	-3.2%	0.5%	9.7%
1994	4.3%	-1.7%	-3.2%	1.0%	0.3%	1.2%	0.9%	-0.2%	-1.7%	1.6%	-3.0%	-0.1%	-1.0%
1995	1.4%	2.0%	1.2%	1.3%	2.2%	0.6%	1.9%	1.1%	2.0%	0.6%	2.9%	4.1%	23.3%
1996	1.5%	1.1%	2.2%	3.5%	0.3%	1.5%	-4.3%	1.9%	3.7%	0.5%	6.1%	-0.9%	18.1%
1997	1.9%	-2.0%	-2.0%	3.5%	2.9%	1.3%	4.5%	-4.7%	3.5%	-3.1%	0.0%	1.2%	6.8%
1998	1.0%	3.4%	3.3%	0.7%	-0.8%	2.2%	-0.5%	-9.1%	0.8%	-0.1%	2.0%	3.0%	5.2%
1999	1.8%	-2.5%	2.9%	3.2%	-1.2%	1.5%	-1.3%	-0.2%	0.8%	-0.4%	3.6%	6.4%	15.3%
2000	-1.9%	2.8%	3.4%	-3.5%	1.9%	3.6%	-4.6%	6.1%	-1.0%	-1.2%	5.0%	2.0%	12.6%
2001	-1.6%	-0.8%	-0.9%	0.5%	-0.0%	2.2%	-0.1%	1.7%	-0.9%	-0.2%	1.3%	0.5%	1.5%
2002	0.2%	0.9%	0.0%	-0.3%	1.1%	0.1%	-4.3%	2.4%	0.4%	-1.7%	-0.3%	3.1%	1.6%
2003	2.6%	4.3%	-5.0%	-1.9%	4.4%	0.3%	2.6%	1.7%	0.9%	3.4%	2.4%	5.3%	22.5%
2004	2.8%	1.7%	2.9%	-5.6%	1.9%	0.0%	1.3%	1.9%	4.0%	4.4%	1.9%	-0.1%	18.0%
2005	-4.5%	4.6%	0.6%	-2.1%	1.0%	2.4%	5.3%	-0.9%	1.9%	-4.9%	1.6%	1.7%	6.3%
2006	6.3%	0.6%	3.2%	0.6%	-3.4%	2.3%	1.7%	3.0%	1.4%	4.6%	3.5%	0.7%	27.2%
2007	4.1%	-1.2%	0.1%	2.5%	1.7%	-3.8%	-0.5%	-2.0%	6.5%	5.6%	-4.2%	1.4%	9.9%
2008	-2.9%	4.6%	-0.3%	2.8%	3.8%	0.9%	-5.8%	-3.0%	-5.2%	-10.0%	1.4%	1.0%	-13.0%
2009	-0.9%	-0.2%	0.6%	-0.5%	-0.4%	-0.5%	5.6%	6.8%	5.0%	-2.6%	5.2%	3.7%	23.7%
2010	-4.5%	2.8%	7.7%	2.8%	-4.7%	-3.0%	3.6%	-1.4%	1.7%	2.9%	-1.0%	6.6%	13.4%
2011	2.2%	3.9%	0.9%	3.7%	-2.3%	-3.2%	0.5%	-4.0%	0.5%	-0.2%	-1.8%	0.2%	0.0%
2012	1.9%	0.9%	2.5%	0.9%	-3.0%	3.2%	1.6%	0.7%	-0.1%	-0.9%	0.9%	2.4%	11.3%
2013	2.9%	0.7%	2.1%	4.0%	-2.0%	-2.7%	1.8%	-3.9%	-0.1%	2.2%	-0.4%	1.2%	5.9%
2014	-3.2%	3.3%	0.4%	0.7%	2.3%	1.7%	-0.9%	2.7%	-3.7%	3.8%	2.0%	0.3%	9.2%
2015	1.2%	1.0%	-0.2%	-1.3%	0.3%	-1.9%	0.8%	-2.6%	0.3%	-0.2%	-0.1%	-0.1%	-2.9%
2016	-2.8%	0.1%	3.4%	-0.5%	1.4%	3.1%	2.6%	-1.2%	-0.5%	-2.8%	1.2%	2.2%	5.9%
2017	1.3%	1.9%	0.2%	1.1%	1.3%	0.2%	2.3%	0.4%	1.0%	1.5%	2.2%	1.0%	15.2%
2018	4.9%	-3.9%	-0.2%	1.4%	0.4%	2.0%	0.4%	2.4%	0.6%	-5.2%	1.4%	-5.0%	-1.4%
2019	0.1%	0.0%	2.7%	1.1%	-1.1%	0.7%	1.0%	2.0%	0.9%	1.0%	0.7%	0.9%	10.5%
2020	-0.5%	-4.3%	0.9%	0.2%	-0.1%	0.7%	2.2%	3.5%	-2.0%	-1.9%	7.9%	3.9%	10.3%
2021	-0.5%	5.0%	1.2%	5.5%	1.1%	2.8%	2.7%	0.9%	-1.5%	6.6%	-4.4%	7.0%	29.2%
2022	-0.5%	1.1%	3.7%	-1.3%	2.3%	-3.5%	-0.0%	-1.2%	-3.4%	0.0%	-0.1%	-1.9%	-4.8%
2023	-0.2%	-2.6%	1.7%	1.1%	-1.4%	3.4%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	2.0%

Backtest-Ergebnisse

IVY-Strategie



VORSICHT



ca +10 % p.a.
max. Rückgang ca 18%

5.5
5.0
4.5
4.0
3.5
3.0
2.5
2.0
1.5
1.0

Year	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	Yr%
1991	N/A	2.6%	0.8%	0.6%	1.7%	-1.7%	2.0%	2.0%	0.2%	1.7%	-2.4%	-1.3%	6.1%
1992	-1.1%	0.6%	-0.8%	1.1%	1.5%	-0.2%	1.7%	-0.3%	1.2%	-1.0%	1.1%	0.9%	4.8%
1993	0.9%	1.0%	1.4%	2.1%	0.8%	0.8%	1.3%	3.4%	-1.0%	1.4%	-3.2%	0.5%	9.7%
1994	4.3%	-1.7%	-3.2%	1.0%	0.3%	1.2%	0.9%	-0.2%	-1.7%	1.6%	-3.0%	-0.1%	-1.0%
1995	1.4%	2.0%	1.2%	1.3%	2.2%	0.6%	1.9%	1.1%	2.0%	0.6%	2.9%	4.1%	23.3%
1996	1.5%	1.1%	2.2%	3.5%	0.3%	1.5%	-4.3%	1.9%	3.7%	0.5%	6.1%	-0.9%	18.1%
1997	1.9%	-2.0%	-2.0%	3.5%	2.9%	1.3%	4.5%	-4.7%	3.5%	-3.1%	0.0%	1.2%	6.8%
1998	1.0%	3.4%	3.3%	0.7%	-0.8%	2.2%	-0.5%	-9.1%	0.8%	-0.1%	2.0%	3.0%	5.2%
1999	1.8%	-2.5%	2.9%	3.2%	-1.2%	1.5%	-1.3%	-0.2%	0.8%	-0.4%	3.6%	6.4%	15.3%
2000	-1.9%	2.8%	3.4%	-3.5%	1.9%	3.6%	-4.6%	6.1%	-1.0%	-1.2%	5.0%	2.0%	12.6%
2001	-1.6%	-0.8%	-0.9%	0.5%	-0.0%	2.2%	-0.1%	1.7%	-0.9%	-0.2%	1.3%	0.5%	1.5%
2002	0.2%	0.9%	0.0%	-0.3%	1.1%	0.1%	-4.3%	2.4%	0.4%	-1.7%	-0.3%	3.1%	1.6%
2003	2.6%	4.3%	-5.0%	-1.9%	4.4%	0.3%	2.6%	1.7%	0.9%	3.4%	2.4%	5.3%	22.5%
2004	2.8%	1.7%	2.9%	-5.6%	1.9%	0.0%	1.3%	1.9%	4.0%	4.4%	1.9%	-0.1%	18.0%
2005	-4.5%	4.6%	0.6%	-2.1%	1.0%	2.4%	5.3%	-0.9%	1.9%	-4.9%	1.6%	1.7%	6.3%
2006	6.3%	0.6%	3.2%	0.6%	-3.4%	2.3%	1.7%	3.0%	1.4%	4.6%	3.5%	0.7%	27.2%
2007	4.1%	-1.2%	0.1%	2.5%	1.7%	-3.8%	-0.5%	-2.0%	6.5%	5.6%	-4.2%	1.4%	9.9%
2008	-2.9%	4.6%	-0.3%	2.8%	3.8%	0.9%	-5.8%	-3.0%	-5.2%	-10.0%	1.4%	1.0%	-13.0%
2009	-0.9%	-0.2%	0.6%	-0.5%	-0.4%	-0.5%	5.6%	6.8%	5.0%	-2.6%	5.2%	3.7%	23.7%
2010	-4.5%	2.8%	7.7%	2.8%	-4.7%	-3.0%	3.6%	-1.4%	1.7%	2.9%	-1.0%	6.6%	13.4%
2011	2.2%	3.9%	0.9%	3.7%	-2.3%	-3.2%	0.5%	-4.0%	0.5%	-0.2%	-1.8%	0.2%	0.0%
2012	1.9%	0.9%	2.5%	0.9%	-3.0%	3.2%	1.6%	0.7%	-0.1%	-0.9%	0.9%	2.4%	11.3%
2013	2.9%	0.7%	2.1%	4.0%	-2.0%	-2.7%	1.8%	-3.9%	-0.1%	2.2%	-0.4%	1.2%	5.9%
2014	-3.2%	3.3%	0.4%	0.7%	2.3%	1.7%	-0.9%	2.7%	-3.7%	3.8%	2.0%	0.3%	9.2%
2015	1.2%	1.0%	-0.2%	-1.3%	0.3%	-1.9%	0.8%	-2.6%	0.3%	-0.2%	-0.1%	-0.1%	-2.9%
2016	-2.8%	0.1%	3.4%	-0.5%	1.4%	3.1%	2.6%	-1.2%	-0.5%	-2.8%	1.2%	2.2%	5.9%
2017	1.3%	1.9%	0.2%	1.1%	1.3%	0.2%	2.3%	0.4%	1.0%	1.5%	2.2%	1.0%	15.2%
2018	4.9%	-3.9%	-0.2%	1.4%	0.4%	2.0%	0.4%	2.4%	0.6%	-5.2%	1.4%	-5.0%	-1.4%
2019	0.1%	0.0%	2.7%	1.1%	-1.1%	0.7%	1.0%	2.0%	0.9%	1.0%	0.7%	0.9%	10.5%
2020	-0.5%	-4.3%	0.9%	0.2%	-0.1%	0.7%	2.2%	3.5%	-2.0%	-1.9%	7.9%	3.9%	10.3%
2021	-0.5%	5.0%	1.2%	5.5%	1.1%	2.8%	2.7%	0.9%	-1.5%	6.6%	-4.4%	7.0%	29.2%
2022	-0.5%	1.1%	3.7%	-1.3%	2.3%	-3.5%	-0.0%	-1.2%	-3.4%	0.0%	-0.1%	-1.9%	-4.8%
2023	-0.2%	-2.6%	1.7%	1.1%	-1.4%	3.4%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	2.0%
Avg	0.6%	1.0%	1.1%	0.9%	0.4%	0.6%	0.8%	0.3%	0.5%	0.2%	1.0%	1.6%	

Aktueller Stand: 1.7.23

US Aktien, Aktien EU, Anleihen

Juli 2023



IVY 5 ETF Strategie 3 aus 5

Rang	Universum	Investiert	US-Symbol	Beispiel (UCITS-ETF)	Einstieg	Einstiegs-kurs ca.	WKN	ISIN	IB Symbol (Neu!)	Börsen-platz	
1	US Aktien	ja	VTI	iShares S&P 500	01.02.23	37,26 €	622391	IE0031442068	IUSA	AEB	
2	Nicht US Aktien	ja	VEU	iShares STOXX Europe 600 ETF	01.02.23	44,83 €	263530	DE0002635307	EXIE	IBIS	
3	Anleihen	ja	BND	Invesco US T-Bond 7-10 Year ETF Dist	03.04.23	34,28 €	A2N7D2	IE00BF2FN646	TRDE	IBIS2	
4	Immobilien	nein	VNQ	iShares US Property Yield UCITS ETF			A0LEW6	IE00B1FZSF77	IUSP	AEB	
5	Rohstoffe	nein	DBC	Rogers International Commodity UCITS ETF			A0JK68	LU0249326488	M9SA	IBIS	
Rang bestimmt über 10 Monatstrend und Volatilität		Bestimmt durch: Kurs über 10 Monats SMA?		nur in den USA handelbar		im EU Raum zugelassen		für deutsche Banken		international gebräuchlich	für IB, Captrader, Lynx usw.



Aktueller Stand: 1.7.23

US Aktien, Aktien EU , Anleihen



Juli 2023

IVY 5 ETF Strategie 3 aus 5

Rang	Universum	Investiert	US-Symbol	Beispiel (UCITS-ETF)	Einstieg	Einstiegs-kurs ca.	WKN	ISIN	IB Symbol (Neu!)	Börsen-platz
1	US Aktien	ja	VTI	iShares S&P 500	01.02.23	37,26 €	622391	IE0031442068	IUSA	AEB
2	Nicht US Aktien	ja	VEU	iShares STOXX Europe 600 ETF	01.02.23	44,83 €	263530	DE0002635307	EXIE	IBIS
3	Anleihen	ja	BND	Invesco US T-Bond 7-10 Year ETF Dist	03.04.23	34,28 €	A2N7D2	IE00BF2FN646	TRDE	IBIS2
4	Immobilien	nein	VNQ	iShares US Property Yield UCITS ETF			A0LEW6	IE00B1FZSF77	IUSP	AEB
5	Rohstoffe	nein	DBC	Rogers International Commodity UCITS ETF			A0JK68	LU0249326488	M9SA	IBIS
Rang bestimmt über 10 Monatstrend und Volatilität		Bestimmt durch: Kurs über 10 Monats SMA?	nur in den USA handelbar	im EU Raum zugelassen			für deutsche Banken	international gebräuchlich	für IB, Captrader, Lynx usw.	



Aktien-USA



\$W2DOW - Monthly 30.06.2023 Open 255.84, Hi 272.26, Lo 255.66, Close 265.65 (4.1%) MA(100)

Aktien-Rest Welt



\$SPBDUSBT - Monthly 30.06.2023 Open 432.792, Hi 432.792, Lo 428.539, Close 429.461 (

Anleihen



\$REIT - Monthly 30.06.2023 Open 2174.59, Hi 2302.22, Lo 2152.75, Close 2289.66 (5.3%)

Immobilien



430



\$SPGSCITR - Monthly 30.06.2023 Open 3096.86, Hi 3345.67, Lo 3086.58, Close 3232.35 (4

420

410

400

Rohstoffe



5,000

4,500

4,000

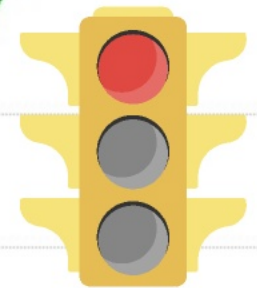
3,500

3,000

2,500

2,000

1,500



Strategie der Universitätsstiftungen Harvard + Yale

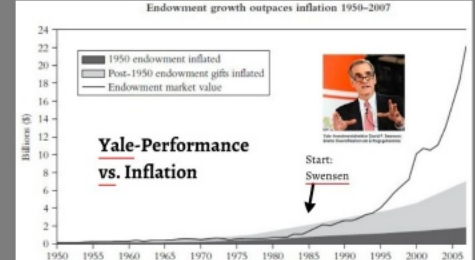


Aktueller Stand: 1.7.23
US Aktien, Aktien EU, Anleihen

Juli 2023

IVY 5 ETF Strategie 3 aus 5

Rang	Universum	Investiert	US-Symbol	Beispiel (UCITS-ETF)	Eintrag	Einsteigskurs ca.	WKN	ISIN	ID Symbol (Neu)	Börsenplatz
1	US Aktien	ja	VIX	WisdomTree VIX	101.02.23	32,29 €	023061	US0381423066	WUSA	WSE
2	Rest of World	ja	VWAG	WisdomTree Europe	101.02.23	44,61 €	023062	US0381423072	ROWA	WSE
3	Immobilien	ja	VHAG	WisdomTree US Property	101.02.23	34,00 €	023063	US0381423088	REUE	WSE
4	Rohstoffe	ja	DDG	Robeco International Commodity	101.02.23	10,00 €	023064	LU0249525488	MSBA	ERS
5	Private Equity	ja	PEAG	Robeco International Private Equity	101.02.23	10,00 €	023065	LU0249525494	PEUE	ERS

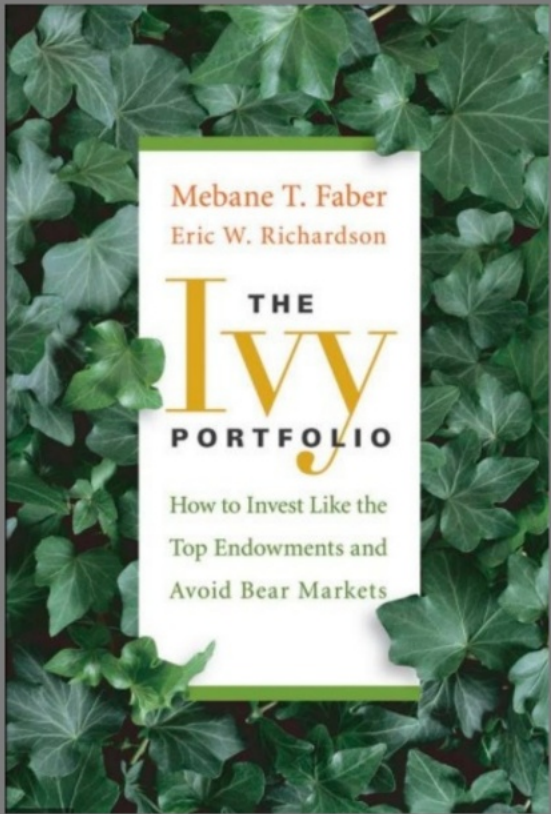


ERGEBNISSE IM VERGLEICH

	Steigung Harvard in %	Steigung Yale in %	Falser Harvard in %	Falser Yale in %
Jährliche Rendite	15,23	16,62	15,81	16,81
Volatilität	8,15	10,40	10,21	10,21
Bestes Jahr	32,20	41,00	47,19	47,19
Schlechteses Jahr	-2,70	-0,20	0,72	0,72
Korrelation zu Yale	51,00	—	79,00	—
Korrel. zu Harvard	—	51,00	85,00	—

Quelle: M&F Fabian Buch „The Ivy Portfolio“, 2008

Figure 1.2 Yale Endowment vs. Inflation, 1950-2007
Source: Yale 2007 endowment report. Mit freundl. Genehmigung: M&F Faber



Buchautor Meb Faber: „Wenn du merkst, dass du ein totes Pferd reitest, steig ab“



Nur zwei Regeln

---> 2 Regeln, immer nur zum Monatsende angewandt:

- 1) Verluste begrenzen
- 2) Beste Teams/ "Championsleague"



Trend der letzten 10 Monate entscheidet

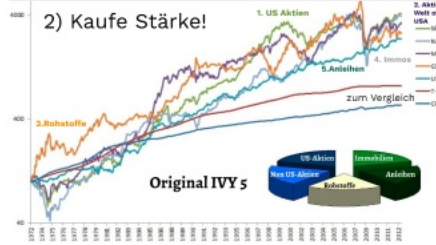
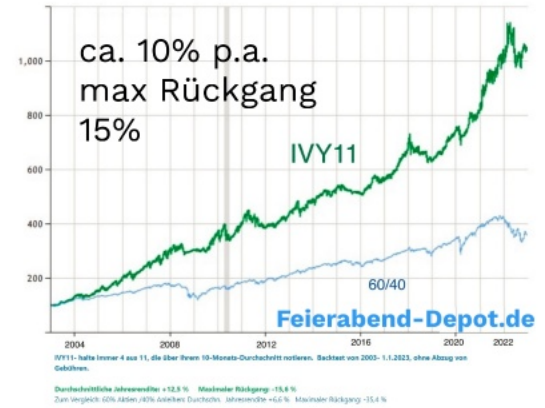
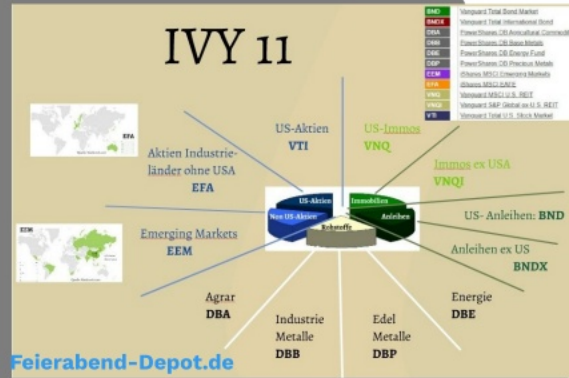
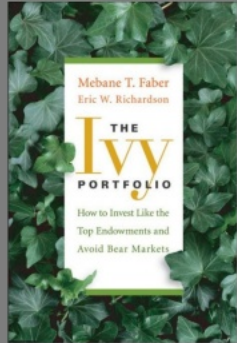


Figure 7.3 S&P 500 Performance from 1900 to 2008

Strategie 1: IVY11

Rotation nur einmal pro Monat

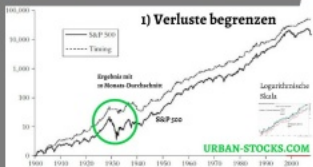
Wähle max 4 aus 11



Nur zwei Regeln

---> 2 Regeln, immer nur zum Monatsende angewandt:

- 1) Verluste begrenzen
- 2) Beste Teams / "Championsleague"



Alle aktuellen Positionen zeigt die folgende Tabelle:

IVY11 ETF Strategie 4 aus 11

Rang	Branche	Investiert	US-Symbol Name (UCITS-ETF)	Einstiegskurs ca.	WKN	ISIN	NEU!	Börsenplatz
1	Aktien Industrieländer ex USA	ja	EFA - iShares S&P 500 Europe 600 ETC	61,82.23	84 75 8	DE0002433303	EKSA	IBIS
2	Edelmetalle (Rohst.)	ja	DBB - iShares Global Gold ETC	103,04.23	59 13 6	DE0000839221	EWQJ	IBIS
3	Agrar (Rohstoffe)	ja	DBA - WisdomTree Agribusiness ETC	111,05.23	5 95 4	GB00B1937883	AURAF	IBIS
4	US-Aktien	ja	VTI - iShares S&P 500	113,97.23	40 17 3	US039301	BUSA	IBIS
5	Anleihen ex USA	nein	BNDX - iShares EUR Govt Bond 10-15yr ETC			AGRLR2 - IE00B4WJXH41	IEGZ	AEB
6	Anleihen Schwedenländer	nein	EEM - iShares MSCI Emerging Markets ETF dist			ADKWC6 - IE00B4M31177	IEEM	AEB
7	US-Anleihen	nein	BND - Invesco US T-Bond 7-10 Year ETF Dist			A2H7D2 - IE00BF2F1646	TRDE	IBIS2
8	Immobilien ex USA	nein	VNOJ - Xtrackers FTSE Dev. Europe Real Estate			DEKDF1 - LU0489337990	DHBK	IBIS2
9	Energie (Rohstoffe)	nein	XLE - iShares MSCI World Energy ETC 1G			A113FF - IE00B4M778M9	XDWO	IBIS2
10	US-Immobilien	nein	VNQ - iShares US Property Yield UCITS ETC			AGLEW6 - IE00B1725F77	IJSP	AEB
11	Industriemetalle (Rohst.)	nein	DBB - WisdomTree Industrial Metals ETC			AKKRK9 - GB00B19KYG56	ODTZ	IBIS2

Annual Performance

Jahr	IVY11	60/40 Portfolio
2003	+30.5%	+21.3%
2004	+19.1%	+11.2%
2005	+22.7%	+7.0%
2006	+28.3%	+13.2%
2007	+22.9%	+8.9%
2008	+1.3%	+0.3%
2009	+19.4%	+13.7%
2010	+10.6%	+12.3%
2011	-4.5%	+2.9%
2012	+12.5%	+12.3%
2013	+13.4%	+13.0%
2014	+6.5%	+5.4%
2015	-2.2%	+0.7%
2016	+8.6%	+4.8%
2017	+21.3%	+14.3%
2018	-2.3%	-3.2%
2019	+16.7%	+19.0%
2020	+10.3%	+13.7%
2021	+27.4%	+9.4%
2022	+0.8%	+0.9%
2023	-1.0%	+8.6%

Aktuelle Marktauswahl, Stand Juli 2023



Umsetzung mit ETFs

Nur zwei Regeln

---> 2 Regeln, immer nur zum **Monatsende** angewandt:

1) Verluste begrenzen



2) Beste Teams/ "Championsleague"



Trend der letzten 10 Monate entscheidet

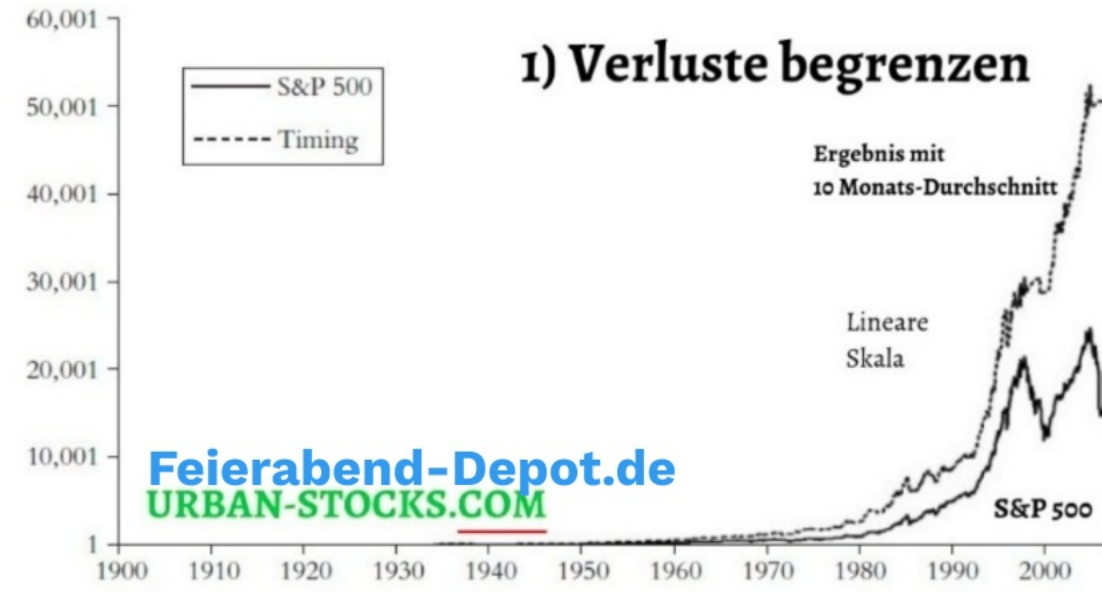
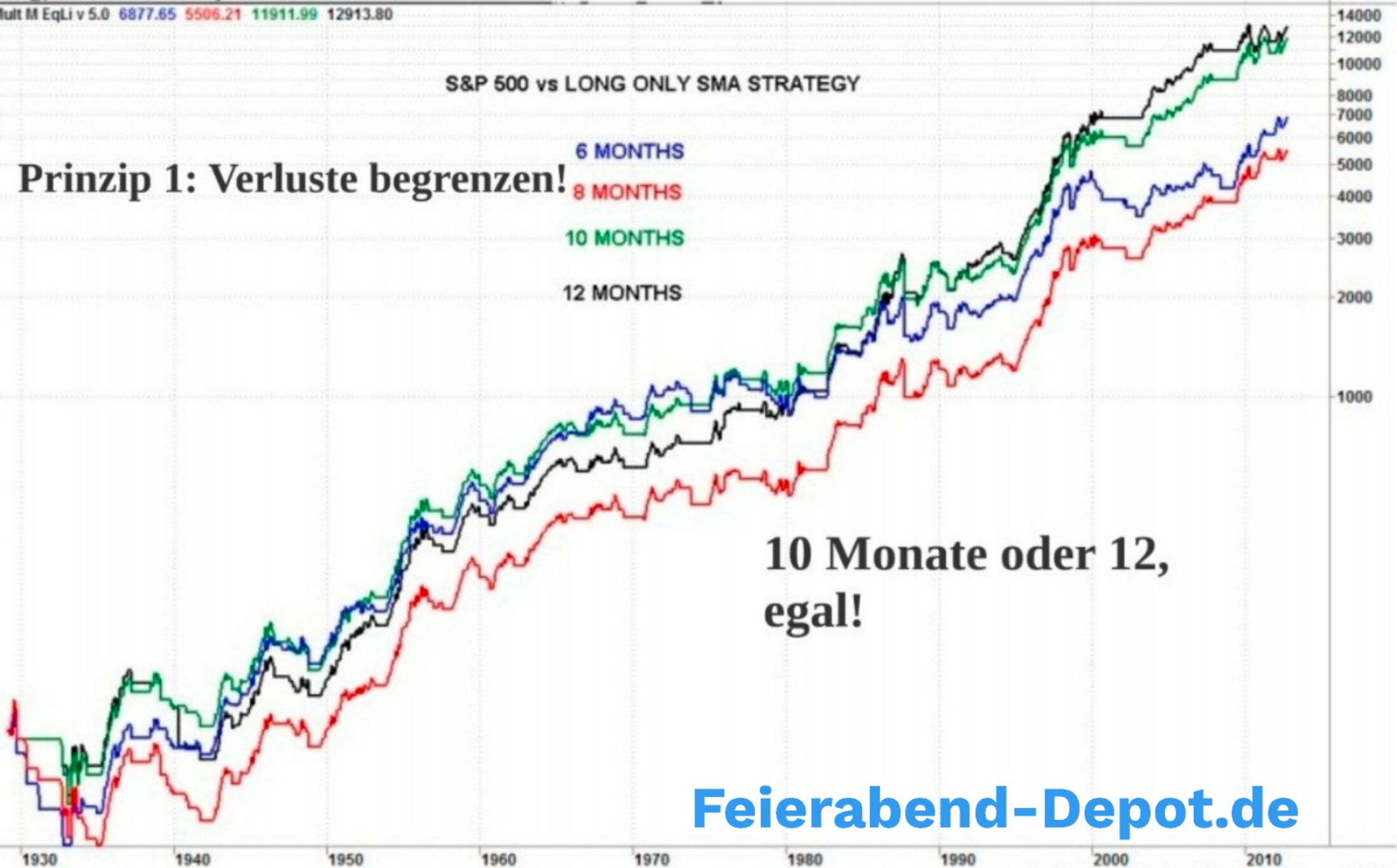


Figure 7.3 S&P 500 Performance from 1900 to 2008

S&P 500 vs LONG ONLY SMA STRATEGY

Prinzip 1: Verluste begrenzen!

- 6 MONTHS
- 8 MONTHS
- 10 MONTHS
- 12 MONTHS



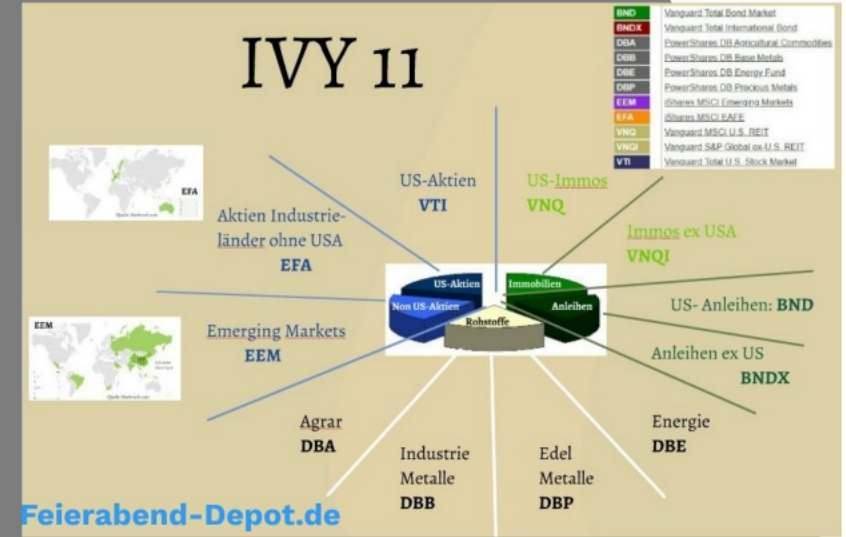
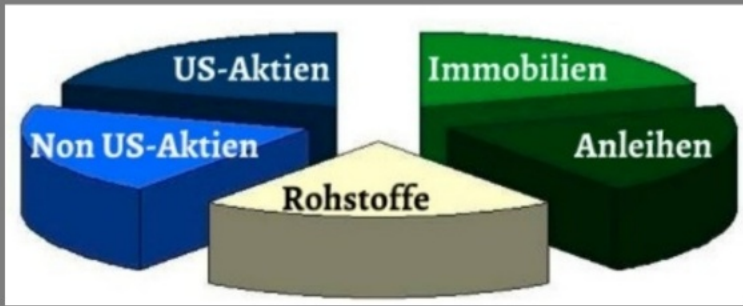
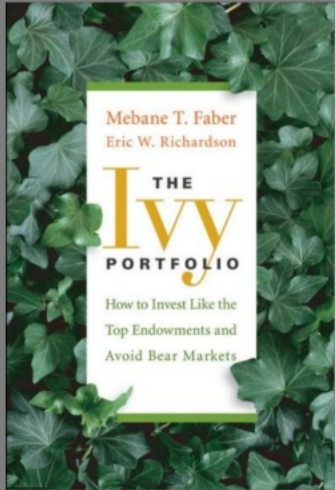
**10 Monate oder 12,
egal!**

Feierabend-Depot.de

Strategie 1: IVY11

Rotation nur einmal pro Monat

Wäh



Nur zwei Regeln

---> 2 Regeln, immer nur zum Monatsende angewandt:

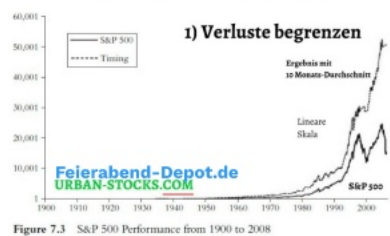
1) Verluste begrenzen



2) Beste Teams/ "Championsleague"



Trend der letzten 10 Monate entscheidet



Alle aktuellen Positionen zeigt die folgende Tabelle:

IVY11		ETF Strategie 4 aus 11			
Rang	Branche	Investiert	US-Symbol	Name (UCITS-ETF)	Einstieg
1	Aktien Industriel. Ex USA	ja	EFA	iShares STOXX Europe 600 ETF	01.02.23
2	Edeelmetalle (Rohst.)	ja	DBP	EUWAX Gold ETC	03.04.23
3	Agrar (Rohstoffe)	ja	DBA	WisdomTree Agriculture	01.05.23
4	US-Aktien	ja	VTI	iShares S&P 500	03.07.23
5	Anleihen ex USA	nein	BNDX	iShares EUR Govt Bond 10-15yr ETF	
6	Aktien Schwellenländer	nein	EEM	iShares MSCI Emerging Markets ETF dist	
7	US-Anleihen	nein	BND	Invesco US T-Bond 7-10 Year ETF Dist	
8	Immobilien ex USA	nein	VNQI	Xtrackers FTSE Dev. Europe Real Estate	
9	Energie (Rohstoffe)	nein	XLE	Xtrackers MSCI World Energy ETF 1C	
10	US-Immobilien	nein	VNQ	iShares US Property Yield UCITS ETF	
11	Industriemetalle (Rohst.)	nein	DBB	WisdomTree Industrial Metals ETC	

Rangliste bestimmt über 10-Monatsrend und Volatilität

Maximal 4, nur in den USA handelbar

im EU Raum zugelassen

Aktuelle Marktauswahl, Stand Juli 2023



IVY 11

BND	Vanguard Total Bond Market
BNDX	Vanguard Total International Bond
DBA	PowerShares DB Agricultural Commodities
DBB	PowerShares DB Base Metals
DBE	PowerShares DB Energy Fund
DBP	PowerShares DB Precious Metals
EEM	iShares MSCI Emerging Markets
EFA	iShares MSCI EAFE
VNQ	Vanguard MSCI U.S. REIT
VNQI	Vanguard S&P Global ex-U.S. REIT
VTI	Vanguard Total U.S. Stock Market



US-Aktien
VTI

Aktien Industrieländer ohne USA
EFA

US-Immobilien
VNQ

Immobilien ex USA
VNQI

US-Anleihen: **BND**

Anleihen ex US
BNDX

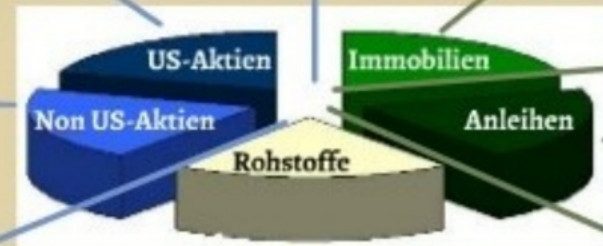
Energie
DBE

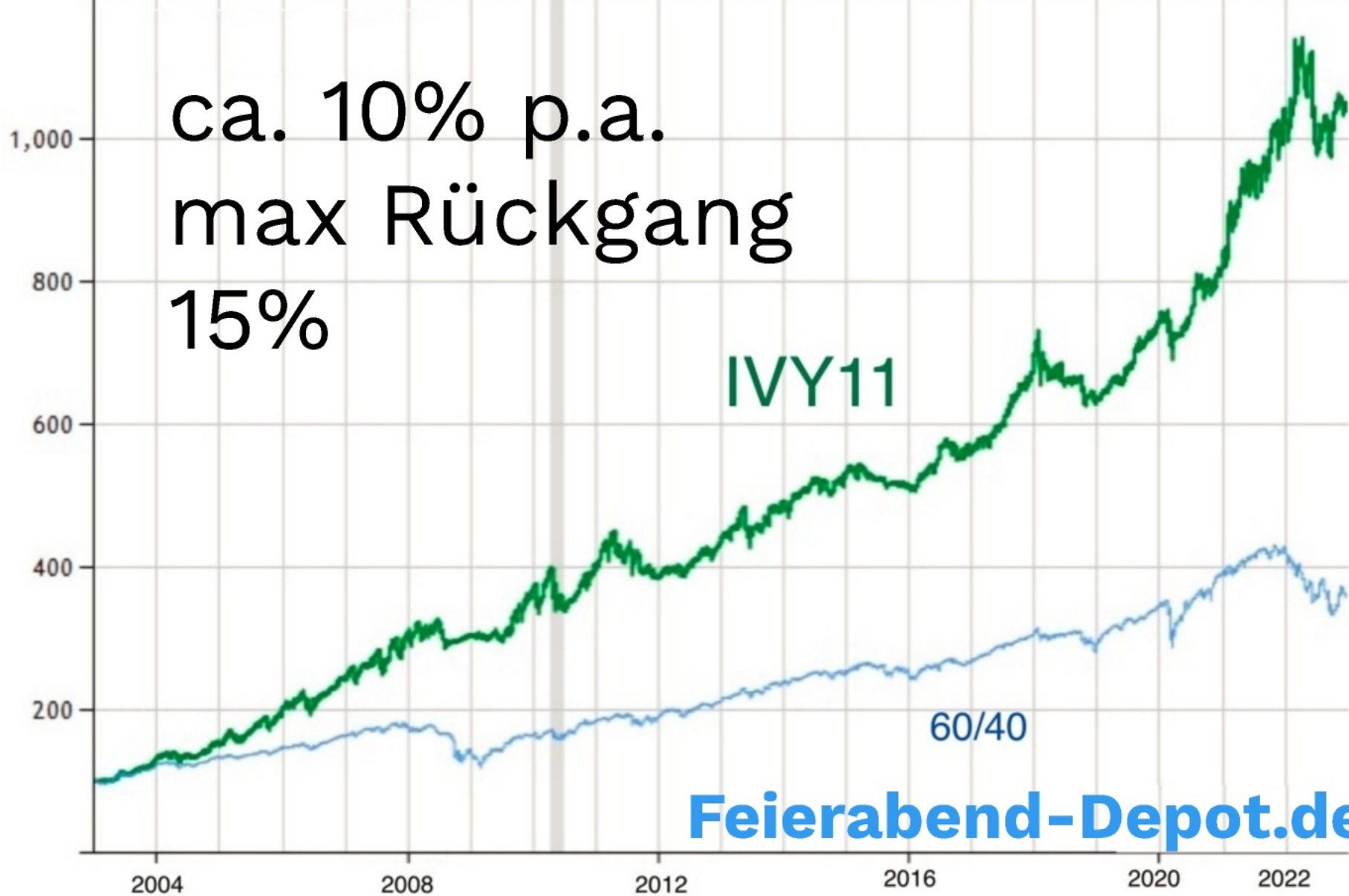
Edelmetalle
DBP

Industriemetalle
DBB

Agrar
DBA

Emerging Markets
EEM





IVY11- halte immer 4 aus 11, die über Ihrem 10-Monats-Durchschnitt notieren. Backtest von 2003- 1.1.2023, ohne Abzug von Gebühren.

Durchschnittliche Jahresrendite: +12,5 % Maximaler Rückgang: -15,6 %

Zum Vergleich: 60% Aktien /40% Anleihen: Durchschn. Jahresrendite +6,6 % Maximaler Rückgang: -35,4 %

ISIN	IB Symbol(Neu!)	Börsen- platz
DE0002635307	EXSA	IBIS
DE000EWG2LD7	EWG2	SWB
GB00B15KYH63	AIGAP	SBF
IE0031442068	IUSA	AEB
IE00B4WXJH41	IEGZ	AEB
IE00B0M63177	IEMM	AEB
IE00BF2FN646	TRDE	IBIS2
LU0489337690	D5BK	IBIS2
IE00BM67HM91	XDW0	IBIS2
IE00B1FZSF77	IUSP	AEB
GB00B15KYG56	OD7Z	IBIS2
ne international gebräuchlich	für IB, Captrader, Lynx usw.	

Annual Performance

Jahr	IVY11	60/40 Portfolio
2003	+30.9%	+21.3%
2004	+19.1%	+11.2%
2005	+22.7%	+7.0%
2006	+28.3%	+13.2%
2007	+22.9%	+8.9%
2008	+1.3%	-19.5%
2009	+19.4%	+13.7%
2010	+10.6%	+12.3%
2011	-4.5%	+2.9%
2012	+12.9%	+12.3%
2013	+13.4%	+13.0%
2014	+6.5%	+5.4%
2015	-2.2%	+0.7%
2016	+8.6%	+4.8%
2017	+21.3%	+14.5%
2018	-6.2%	-5.2%
2019	+16.7%	+19.0%
2020	+10.3%	+13.7%
2021	+27.4%	+9.4%
2022	+0.8%	-15.9%
2023	-1.0%	+8.6%



Alle aktuellen Positionen zeigt die folgende Tabelle:

IVY11		ETF Strategie 4 aus 11							NEU!	
Rang	Branche	Investiert	US-Symbol	Name (UCITS-ETF)	Einstieg	Einstiegskurs ca.	WKN	ISIN	IB Symbol(Neul)	Börsenplatz
1	Aktien Industriel. Ex USA	ja	EFA	iShares STOXX Europe 600 ETF	01.02.23	44,75 €	263530	DE0002635307	EXSA	IBIS
2	Edelmetalle (Rohst.)	ja	DBP	EUWAX Gold ETC	03.04.23	59,13 €	EWG2LD	DE000EWG2LD7	EWG2	SWB
3	Agrar (Rohstoffe)	ja	DBA	WisdomTree Agriculture	01.05.23	5,95 €	A0KRR8	GB00B15KYH63	AIGAP	SBF
4	US-Aktien	ja	VTI	iShares S&P 500	03.07.23	40,57 €	622391	IE0031442068	IUSA	AEB
5	Anleihen ex USA	nein	BNDX	iShares EUR Govt Bond 10-15yr ETF			A0RL82	IE00B4WXJH41	IEGZ	AEB
6	Aktien Schwellenländer	nein	EEM	iShares MSCI Emerging Markets ETF dist			A0HGWC	IE00B0M63177	IEMM	AEB
7	US-Anleihen	nein	BND	Invesco US T-Bond 7-10 Year ETF Dist			A2N7D2	IE00BF2FN646	TRDE	IBIS2
8	Immobilien ex USA	nein	VNQI	Xtrackers FTSE Dev. Europe Real Estate			DBX0F1	LU0489337690	D5BK	IBIS2
9	Energie (Rohstoffe)	nein	XLE	Xtrackers MSCI World Energy ETF 1C			A113FF	IE00BM67HM91	XDWO	IBIS2
10	US-Immobilien	nein	VNQ	iShares US Property Yield UCITS ETF			A0LEW6	IE00B1FZSF77	IUSP	AEB
11	Industriemetalle (Rohst.)	nein	DBB	WisdomTree Industrial Metals ETC			A0KRRG	GB00B15KYG56	ODTZ	IBIS2

Rangliste bestimmt über 10-Monattrend und Volatilität

Maximal 4, von oben nach unten

nur in den USA handelbar

im EU Raum zugelassen

für deutsche Banken international gebräuchlich

für IB, Captrader, Lynx usw.

Aktuelle Marktauswahl, Stand Juli 2023



Annual Performance

Jahr	IVY11	60/40 Portfolio
2003	+30.9%	+21.3%
2004	+19.1%	+11.2%
2005	+22.7%	+7.0%
2006	+28.3%	+13.2%
2007	+22.9%	+8.9%
2008	+1.3%	-19.5%
2009	+19.4%	+13.7%
2010	+10.6%	+12.3%
2011	-4.5%	+2.9%
2012	+12.9%	+12.3%
2013	+13.4%	+13.0%
2014	+6.5%	+5.4%
2015	-2.2%	+0.7%
2016	+8.6%	+4.8%
2017	+21.3%	+14.5%
2018	-6.2%	-5.2%
2019	+16.7%	+19.0%
2020	+10.3%	+13.7%
2021	+27.4%	+9.4%
2022	+0.8%	-15.9%
2023	-1.0%	+8.6%

25
24
23
22
21
20
19
18
17
16
15
14
13

Alle aktuellen Positionen zeigt die folgende Tabelle:

IVY11		ETF Strategie 4 aus 11							NEU!	
Rang	Branche	Investiert	US-Symbol	Name (UCITS-ETF)	Einstieg	Einstiegs-kurs ca.	WKN	ISIN	IB Symbol(Neu!)	Börsen-platz
1	Aktien Industriel Ex USA	ja	EFA	iShares STOXX Europe 600 ETF	01.02.23	44,75 €	263530	DE0002635307	EXSA	IBIS
2	Edelmetalle (Rohst.)	ja	DBP	EUWAX Gold ETC	03.04.23	59,13 €	EWG2LD	DE000EWG2LD7	EWG2	SWB
3	Agrar (Rohstoffe)	ja	DBA	WisdomTree Agriculture	01.05.23	5,95 €	A0KRK8	GB00B15KYH63	AIGAP	SBF
4	US-Aktien	ja	VTI	iShares S&P 500	03.07.23	40,57 €	622391	IE0031442068	IUSA	AEB
5	Anleihen ex USA	nein	BNDX	iShares EUR Govt Bond 10-15yr ETF			A0RL82	IE00B4WXJH41	IEGZ	AEB
6	Aktien Schwellenländer	nein	EEM	iShares MSCI Emerging Markets ETF dist			A0HGWC	IE00B0M63177	IEMM	AEB
7	US-Anleihen	nein	BND	Invesco US T-Bond 7-10 Year ETF Dist			A2N7D2	IE00BF2FN646	TRDE	IBIS2
8	Immobilien ex USA	nein	VNQI	Xtrackers FTSE Dev. Europe Real Estate			DBX0F1	LU0489337690	D5BK	IBIS2
9	Energie (Rohstoffe)	nein	XLE	Xtrackers MSCI World Energy ETF 1C			A113FF	IE00BM67HM91	XDW0	IBIS2
10	US-Immobilien	nein	VNQ	iShares US Property Yield UCITS ETF			A0LEW6	IE00B1FZSF77	IUSP	AEB
11	Industriemetalle (Rohst.)	nein	DBB	WisdomTree Industrial Metals ETC			A0KRKG	GB00B15KYG56	OD7Z	IBIS2
Rangliste bestimmt über 10-Monatstrend und Volatilität		Maximal 4, von oben nach unten	nur in den USA handelbar	im EU Raum zugelassen			für deutsche Banken	international gebräuchlich	für IB, Captrader, Lynx usw.	

Aktuelle Marktauswahl, Stand Juli 2023

EFA - Monthly 22.06.2023 Open 69.7707, Hi 73.91, Lo 69.7216, Close 72.08 (3.9%) MA(Clo

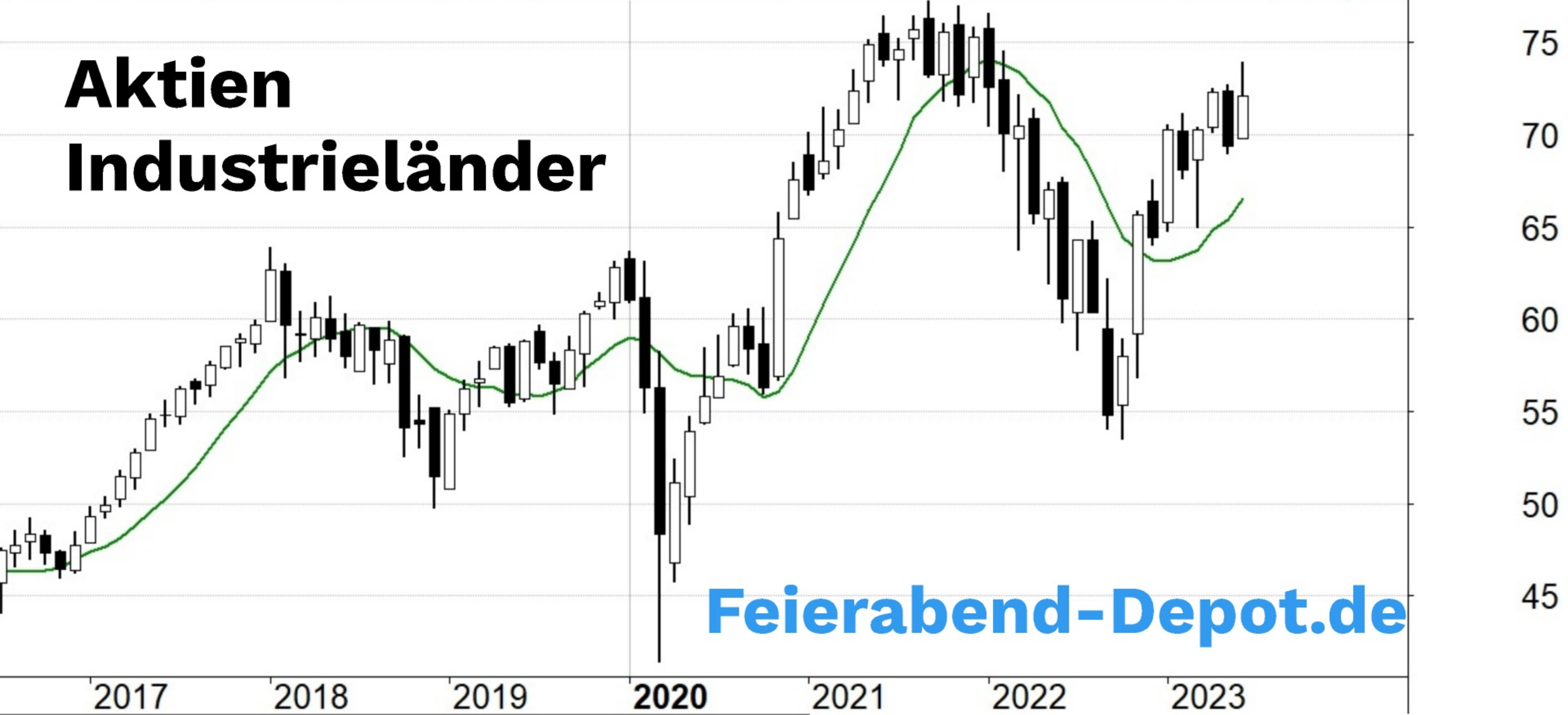
Aktien Industrieländer



75
70

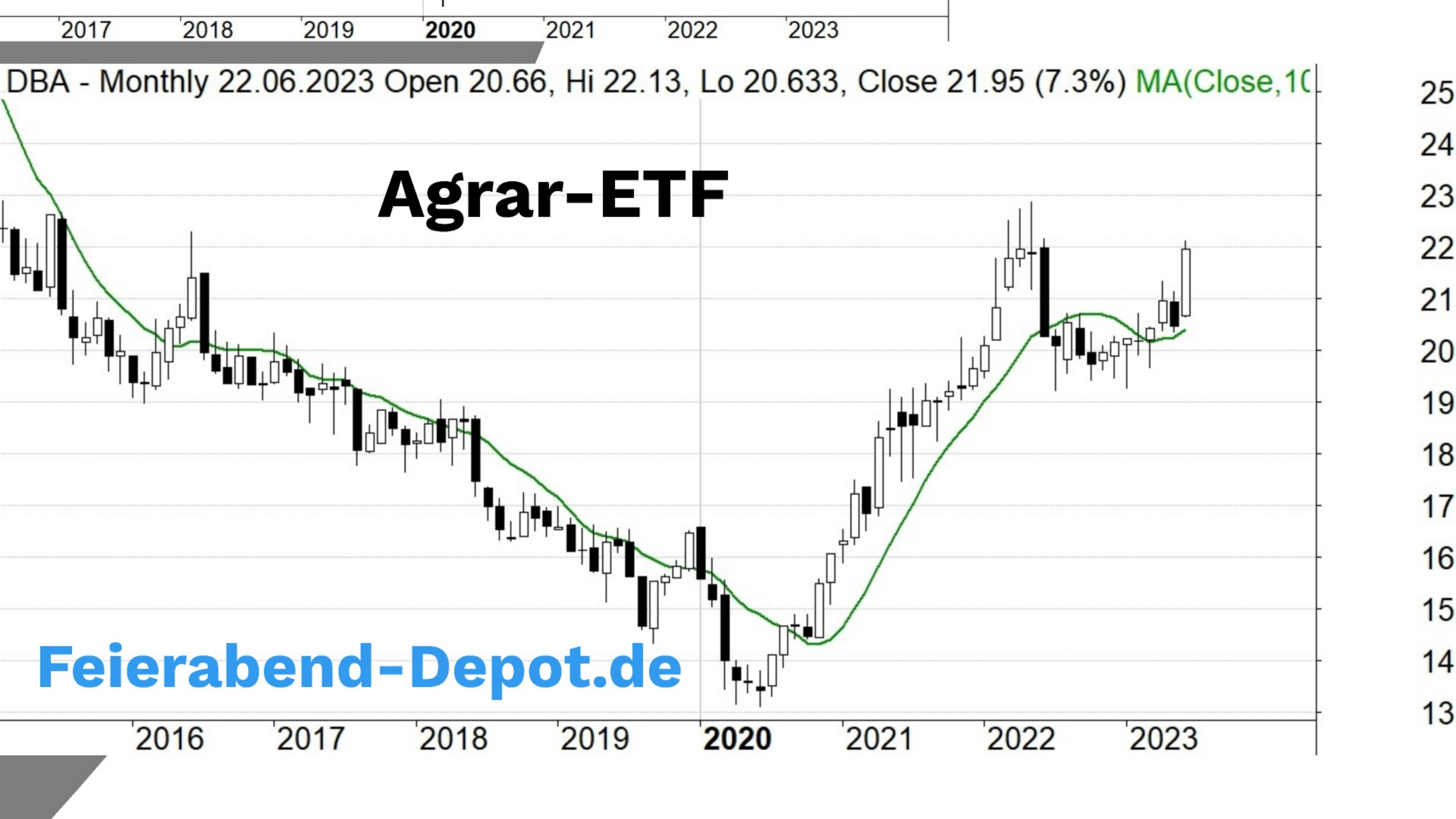
EFA - Monthly 22.06.2023 Open 69.7707, Hi 73.91, Lo 69.7216, Close 72.08 (3.9%) MA(Clo

Aktien Industrieländer



Feierabend-Depot.de

DBA - Monthly 22.06.2023 Open 20.66, Hi 22.13, Lo 20.633, Close 21.95 (7



2017

2018

2019

2020

2021

2022

2023

DBA - Monthly 22.06.2023 Open 20.66, Hi 22.13, Lo 20.633, Close 21.95 (7.3%) MA(Close,10)

Agrar-ETF

Feierabend-Depot.de

2016

2017

2018

2019

2020

2021

2022

2023

25

24

23

22

21

20

19

18

17

16

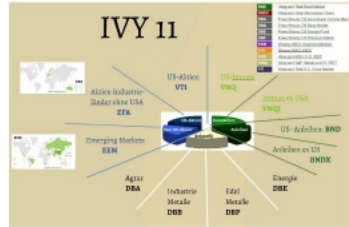
15

14

13

"3 Strategien, die funktionieren"

1. IVY 11: ETFs



- + Nur zwei Regeln
- + 1 Mal pro Monat
- + 4 aus 11
- + Backtests + Positionen

2. Saisonalität: Aktien

Symbol	Name	Wert	Änderung	Änderung %	Rank
AAA	AAA	100	0	0%	1
BBB	BBB	95	-5	-5%	2
CCC	CCC	90	-5	-5%	3
DD	DD	85	-5	-5%	4
EE	EE	80	-5	-5%	5
FF	FF	75	-5	-5%	6
GG	GG	70	-5	-5%	7
HH	HH	65	-5	-5%	8
II	II	60	-5	-5%	9
JJ	JJ	55	-5	-5%	10
KK	KK	50	-5	-5%	11

- + Rangliste
- + Faktoren: Momentum und Saisonalität
- + Backtests + Positionen

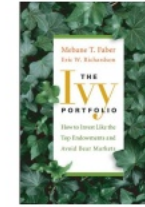
3. Optionen + Aktien



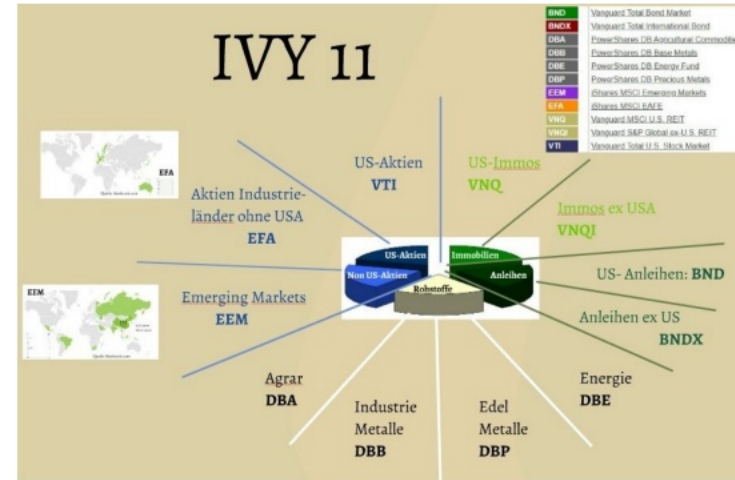
- + Diskretionäres Trading
- + Optionen verkaufen
- + NICHT im Feierabend-Depot



Haftungsausschließung und Copyright:
 Die hier dargestellten Informationen stellen weder ein öffentliches Angebot noch eine Aufforderung zu Anlage oder Eingriffen zum Zweck des Wertpapier- oder Futureshandels dar und sind kein Ersatz für eine auf die individuellen Verhältnisse und Interessen des Anlegers basierende Finanzberatung. Sie dienen ausschließlich Informationszwecken. Mit den Inhalten dieser Informationen und/oder den auf Basis dieser Informationen getroffenen Entscheidungen sind keine Vermögensgegenstände, keine Anlagensicherheiten oder sonstige Rechte verbunden. Die Informationen sind ausschließlich für den privaten Gebrauch bestimmt und dürfen nicht für andere Zwecke weitergegeben werden. Die Informationen sind ausschließlich für den privaten Gebrauch bestimmt und dürfen nicht für andere Zwecke weitergegeben werden. Die Informationen sind ausschließlich für den privaten Gebrauch bestimmt und dürfen nicht für andere Zwecke weitergegeben werden.



"Ergebnisse wie am Aktienmarkt, aber mit niedrigeren Rückgängen"

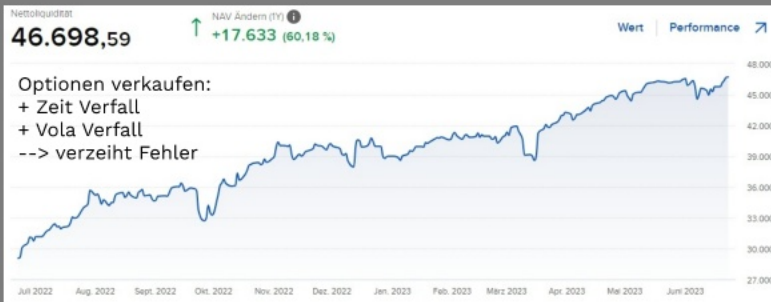


Legend:
 BND: Vanguard Total Bond Market
 BNDX: Vanguard Total International Bond
 CDBX: PowerShares DB Commodity Commodity
 CDB: PowerShares DB Energy Fund
 DBE: PowerShares DB Energy Fund
 DBP: PowerShares DB Precious Metals
 DBB: PowerShares DB Precious Metals
 EEM: iShares MSCI Emerging Markets
 EFA: iShares MSCI EAFE
 EEM: iShares MSCI EAFE
 VNO: Vanguard S&P Global ex-U.S. REIT
 VNI: Vanguard S&P Global ex-U.S. REIT
 VTI: Vanguard Total U.S. Stock Market

Real gehandelt mit Captrader//
 Für Fortgeschrittene

Urban Jäkke, [Feierabend-Depot.de](https://www.feierabend-depot.de) [urban-stocks.com](https://www.urban-stocks.com)

Strategie 3: Optionen



Backtest

Beispiel



Vola aktuell:



Letzter-Trade



S&P 500 is pricing in a big move and therefore option prices are expensive. A premium seller's dream.

There are also volatility indexes for other underlyings:

- Russell 2000 Index (Ticker: RVX)
- Nasdaq 100 Index (Ticker: VXX)
- Gold (Ticker: GVZ)
- Oil (Ticker: OVX)
- Treasury Bonds (Ticker: TVIX)

Regeln

- Entry: Verkaufe Strangle (d.h. Call und Put Option)
- Laufzeit (DTE) 50-70 Tage
- Delta 6-8
- Wichtig: welcher Markt (Implizierte Vola hoch!)
- Exit: Kursziel 60%, Stop -250%
- Margin < 50%

Interesse an einem Workshop dazu:
Videokurs + Webinar + Treffen
(Frankfurt)

Mail: info@urban-stocks.com

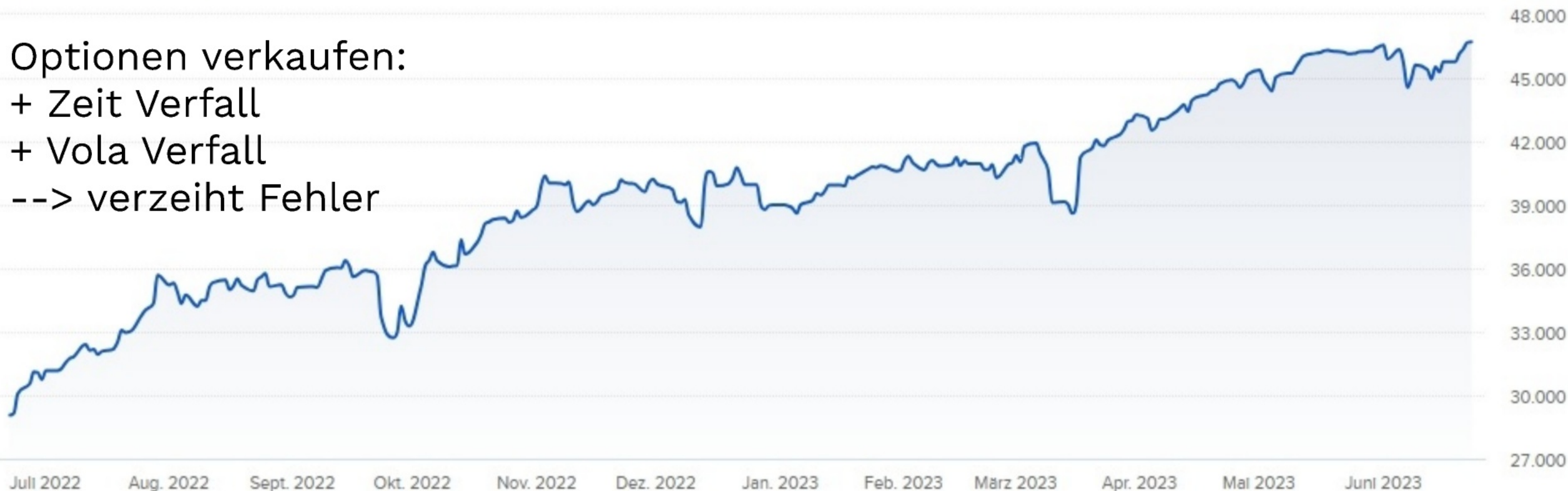
Nettolliquidität

46.698,59

NAV Ändern (1Y) ⓘ
↑ **+17.633 (60,18 %)**

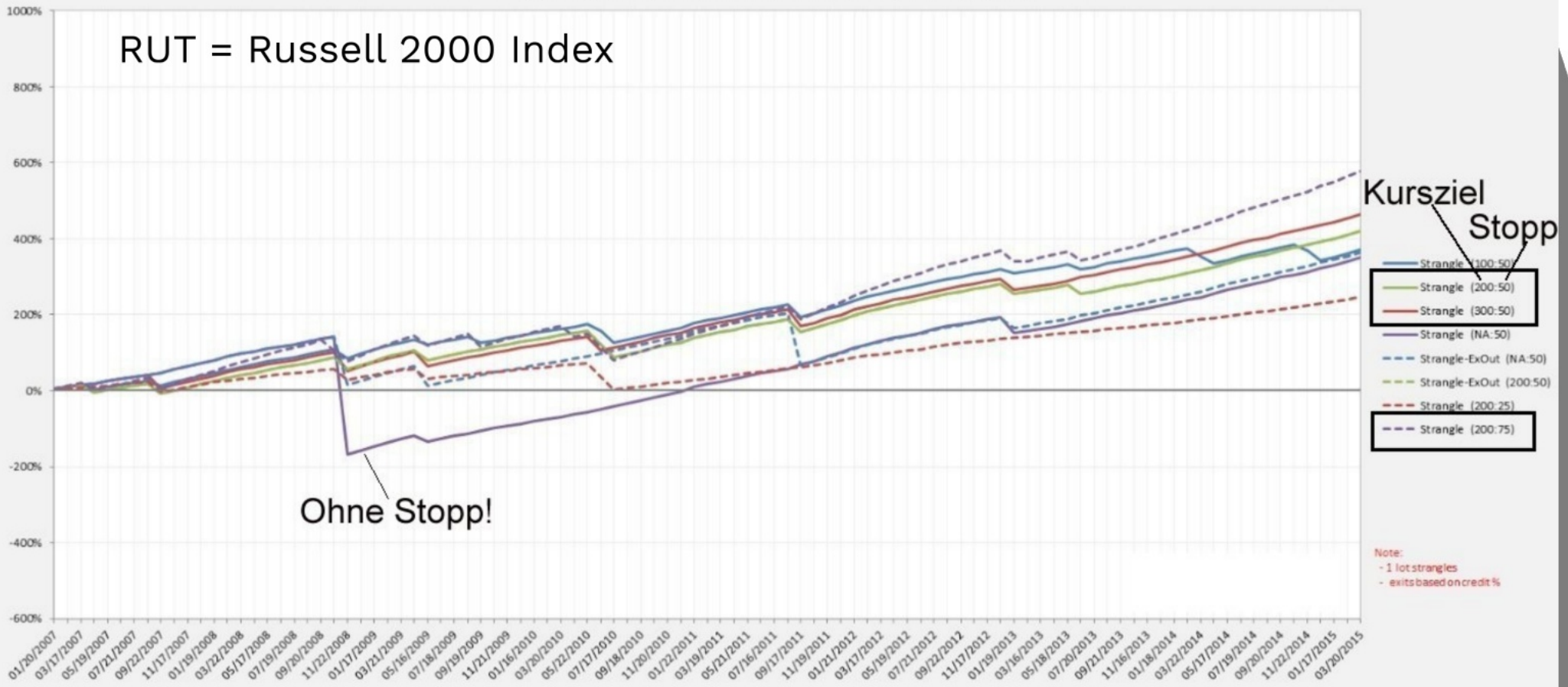
Wert | Performance ↗

Optionen verkaufen:
+ Zeit Verfall
+ Vola Verfall
--> verzeiht Fehler



Backtest

RUT - 6 Delta Strangle - 66 DTE Carried to Expiration
(Cumulative Non Compounded Normalized % Profit)



128.47	O
-3.92	C
124.55	
-206.00	O
120.00	C
-96.00	

Beispiel

Transaktionen		13.9.: Trade Eröffnung	610+1059=1669	kassiert								
RUT 18NOV22 2145 C	2022-09-13, 12:09:24	Call	-1	6.1000	4.8153	610.00	-1.20					
RUT 18NOV22 2145 C	2022-10-20, 13:04:05		1	0.3200	0.2808	-32.00	-1.20					
Gesamt RUT 18NOV22 2145 C			0			578.00	-2.40	0.00	575.60			
RUT 18NOV22 1500 P	2022-09-13, 12:09:24	Put	-1	10.5900	12.6500	1,059.00	-1.20	-1,057.80	0.00			
RUT 18NOV22 1500 P	2022-10-20, 13:04:05		1	8.7000	9.9000	-870.00	-1.20	1,057.80	186.60			
Gesamt RUT 18NOV22 1500 P			0			189.00	-2.40	0.00	186.80			

20.10: Trade Schliessung
32+870 = 902 bezahlt
46% Gewinn



GVZ s.u., aus der

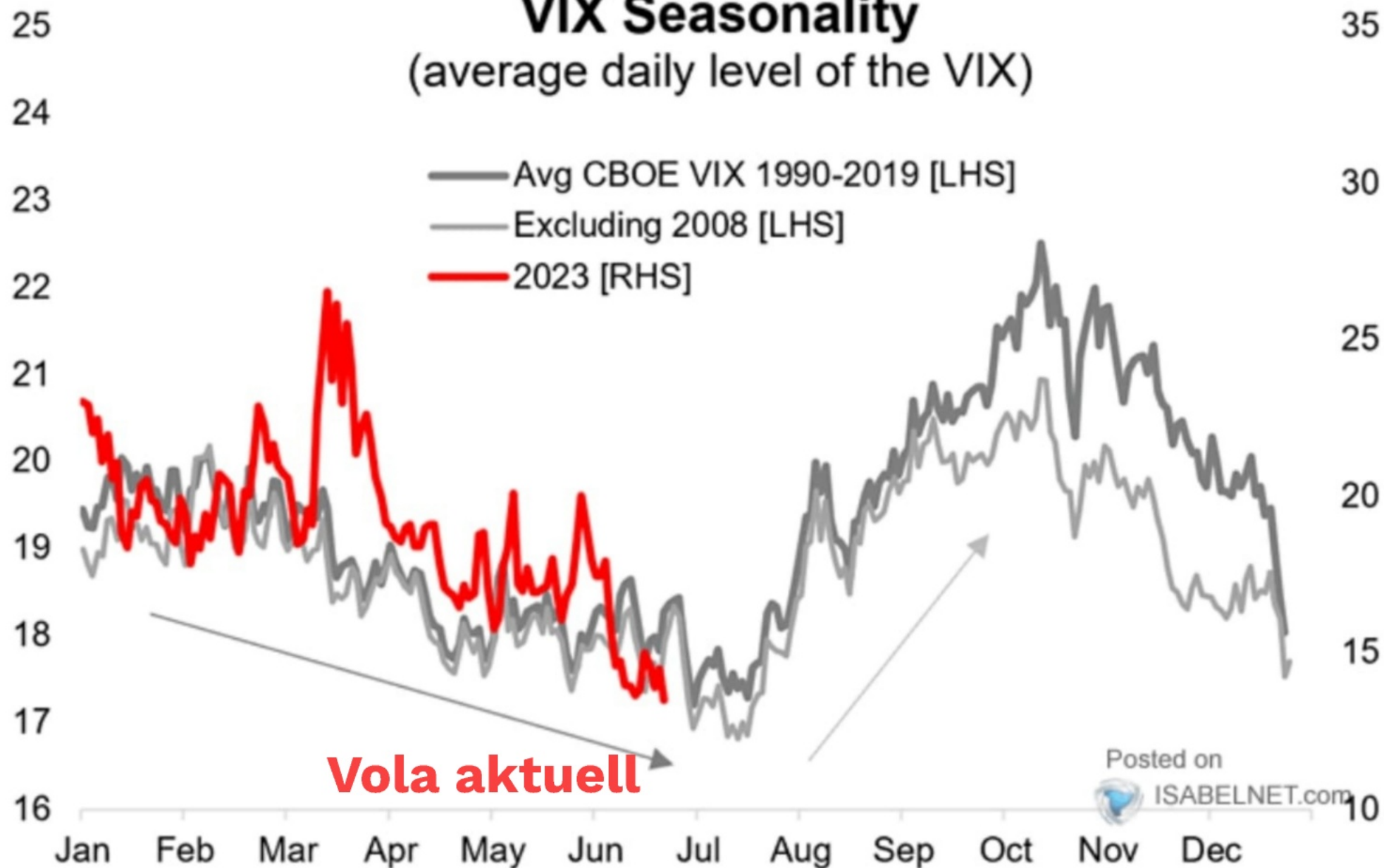
S&P 500
A pre

There

-
-
-

VIX Seasonality

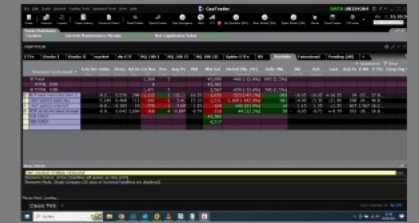
(average daily level of the VIX)



Vola aktuell

Posted on
ISABELNET.com

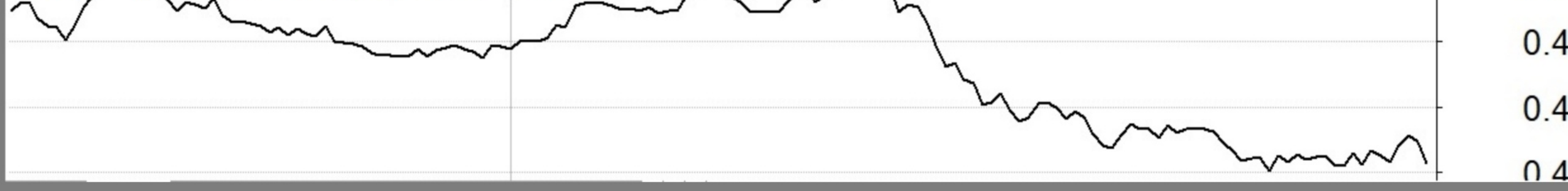
Letzter-Trade



\$RUT - Daily 25.05.2023 Open 1767.1, Hi 1767.1, Lo 1741.24, Close 1754.6 (-0.7%) MA(Clc



\$RUT - (\$RUT / \$SPX) spread = 0.42



Video N6 noch ein RUT strangle 25Mai23

RVX Index
(=Vola des Russell)



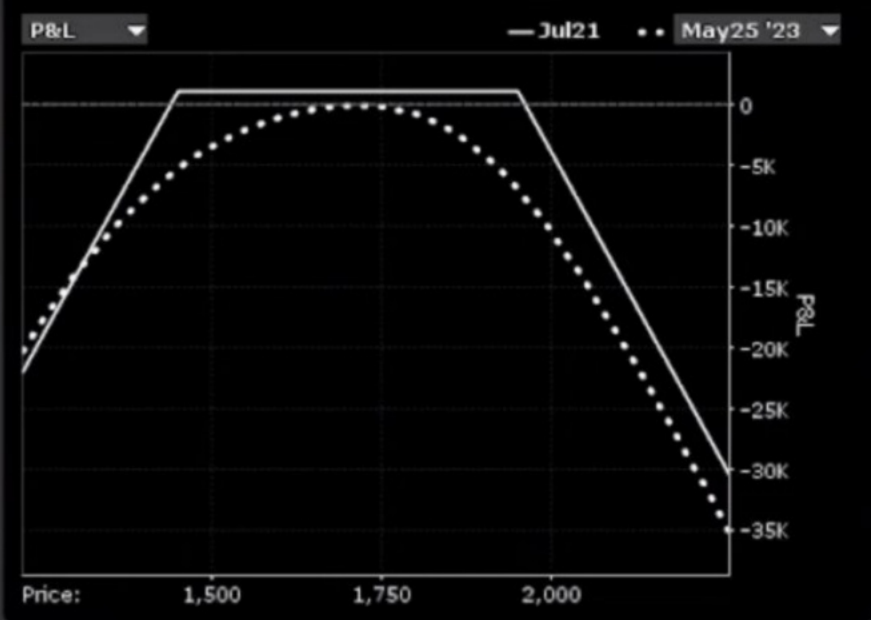
Orders Log Trades Portfolio

Video N6 noch ein RUT strangle 25Mai23

QUOTE DETAILS

Bid/Ask -11.60 x -10.90
 Size 445 x 1
 Performance
 Return/Risk
 Profit Probability 89%
 Max Return 1,089
 (88% chance) 101%
 Max Loss -∞
 (<1% chance) ∞
 Aggressiveness Unknown
 MinInvest -1,078
 Break Even 1,439.11, 1,960.89
 Commission 2
 Commission% 0
 Mgn Imp 9,799

PERFORMANCE GRAPH



SCENARIOS Instrument Greeks 30.0% Move May25 '23

	-30%	-20%	-10%	Current	+10%	+20%	+30%
Underlying	1,219	1,393	1,568	1,742	1,916	2,090	2,264
P&L	-20292.17	-7937.18	-1660.49	-122.39	-4895.19	-18116.51	-35163.41
Delta	0.85	0.52	0.21	-0.05	-0.53	-0.91	-0.99
Gamma	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
Vega	-1.13	-2.23	-1.87	-2.05	-3.28	-1.41	-0.17

Order Confirmation

Financial Instrument	Bid	Ask
RUT Jul20 1450/1950 Short S...	-11.60	-10.90

Order Description
 RUT Jul20 1450/1950 Short Strangle
 Sell 1 RUT Jul20'23 1450 PUT
 Sell 1 RUT Jul20'23 1950 CALL

Order Type LMT Routing SMART Time in Force DAY
 Limit Price -11.20 C

Amount -1,120 USD C
 Commission (est.) 2.10 ... 2.46 USD
 Total ~ -1,117.72 USD C

Balances (In EUR)
 Equity with Loan 46,158 0.00
 Initial Margin 0.00 10,779
 Maintenance Margin 0.00 9,799

*This is a current projection and is subject to [Margin Impact of Spread](#)

Don't display this message again.

Transmit Cancel

Clear All Legs - CLOSE PROFILE + Add to Watchlists

-11.60 -10.90
 BID MID ASK

\$RUT - Daily 07.06.2023 Open 1861.2, Hi 1893.56, Lo 1861.2, Close 1888.45 (1.8%) MA(Close)



schneller Anstieg

Positions Eröffnung

PORTFOLIO

- ETFs
- Stocks I
- Stocks II
- market
- div ETF
- NQ 100 I
- NQ 100 II
- NQ 100 III
- Spider ETFs
- UX
- *Portfolio**
- Feierabend
- Pending (All)
- +

Financial Instrument	Tckr	Act	Delta	Theta	Bd Sz	Cst Bss	Pos	Avg Px	Mid	Mkt Val	Unrlzd P&L (%)	Daily P&L	Bid	Ask	Last	Ask Sz	P Dlt	P Tht	Chng	Chg %
	Key	Accnt	Action	Qty	TIF	Type	Lmt Px	Aux. Px	Dest	Transmit	Status	Trd Px	Cancel							
Total						-1,371	5			44,689	-1,450 (-105.8%)	-1,003 (-2...)								
TOTAL EUR						0				43,302										
TOTAL USD						-1,471	5			1,489	-1,557 (-105.8%)	-1,077 (-2...)								
RUT Jul20 1450/1950 Short S...						40	-1,112	1	-11...	-26.65	-2,691	-1,579 (-142.0%)	-1,025	-27.20	-26.10	m-26.65	109			
RUT Jul20'23 1950 CALL						109	-342	-1	3.41	25.25	-2,560	-2,218 (-649.0%)	-1,057	24.90	25.60	c15.05	155			
RUT Jul20'23 1450 PUT						302	-770	-1	7.69	1.40	-131	639 (83.0%)	32	1.20	1.60	c1.60	276			
XOP Jul 95/145 Short Strangle			-0.0...	0.041	1,239	-360	4	-0.899	-0.85	-338	22 (6.1%)	-52	-0.91	-0.80	m-0.85	709	-33...	16.3...		
EUR CASH										43,302										
USD CASH										4,517										

Stopp bei -250%

News: EUR.USD

TIME-SOURCE-SYMBOL-HEADLINE	RANK
15:57 MNI US: House Fin Cmtte Hearing On Preserving US Dollar's Global Reserve Status	
14:29 MNI US: Yellen Sees Path To Curbing Inflation/ Maintaining Labour Strong Lab Market	
14:14 MNI US: MNI POLITICAL RISK - McCarthy's Conservative Problem Escalates	
13:56 DJ DEISEN/Swissquote sieht Euro bei 1,07 USD unterstützt	

JUL 28 '23 RUTW ^W 100 45 DAYS	JUL 31 '23 RUTW ^W 100 48 DAYS	AUG 17 '23 RUT 100 65 DAYS AM	AUG 31 '23 RUTW ^W 100 79 DAYS	MORE ▾
---	---	---	---	--------

TABBED VIEW ▾ PUT/CALL ▾ All STRIKES ▾ SMART ▾ TRADING CLASS ▾ 100

CALLS							PUTS									
THETA	VEGA	GAMMA	DELTA	OPTN	OPN IN...	VOLUME	BID x ASK	STRIKE	BID x ASK	VOLUME	OPTN	OPN IN...	DELTA	GAMMA	VEGA	THETA
-0.509	1.606	0.001	0.880				222.00 x 224.50	1695	11.60 x 12.20			9	-0.120	0.001	1.606	-0.264
-0.504	1.568	0.001	0.884				225.40 x 229.10	1690	11.20 x 11.80			141	-0.116	0.001	1.568	-0.261
-0.500	1.530	0.001	0.888				231.10 x 233.70	1685	10.80 x 11.30			39	-0.112	0.001	1.530	-0.257
-0.495	1.493	0.001	0.892		3		234.50 x 238.20	1680	10.50 x 11.00	10		112	-0.108	0.001	1.493	-0.253
-0.491	1.457	0.001	0.896		1		239.10 x 242.80	1675	10.10 x 10.60	2		7	-0.104	0.001	1.457	-0.249
-0.486	1.421	0.001	0.899				243.70 x 247.50	1670	9.80 x 10.30			14	-0.101	0.001	1.421	-0.245
-0.482	1.388	0.001	0.902		3		248.30 x 252.10	1665	9.40 x 10.00			3	-0.098	0.001	1.388	-0.241
-0.478	1.356	0.001	0.905		3		252.90 x 256.70	1660	9.20 x 9.60			695	-0.095	0.001	1.356	-0.238
-0.473	1.322	0.001	0.908				257.60 x 261.40	1655	8.80 x 9.40			5	-0.092	0.001	1.322	-0.235
-0.470	1.293	0.001	0.911		11		262.20 x 266.00	1650	8.60 x 9.00	1		140	-0.089	0.001	1.293	-0.232
-0.464	1.259	0.001	0.914		1		266.90 x 270.70	1645	8.30 x 8.80				-0.086	0.001	1.259	-0.227
-0.460	1.229	0.001	0.917		5		271.60 x 275.40	1640	8.00 x 8.50			105	-0.083	0.001	1.229	-0.224

ON Strategy Builder Strategies ▾

ACTN	RT	LST TRD DAY	STRIKE	TYPE	DELTA	THETA	BID/ASK	SIZE
Leg 1	Sell	1 AUG 17 '23	1620	Put	-0.073	-0.210	7.00 x 7.50	374 x 98

Clear All Legs + PROFILE + Add to Watchlists

7.00 7.50

BID MID ASK

Neuer Put + 720\$ Prämie

Risiko reduziert

Margin Impact: -83 EUR

7.6.2023

CONSOLIDATED LMT ▾ QTY 1 LMT 7.20 Credit DAY ▾ advanced +

Order Entry Account: U8354264 Submit Order

Nettoliquidität

46.698,59



NAV Ändern (1M) ⓘ

+471,66 (1,20 %)

Wert

Performance



7D

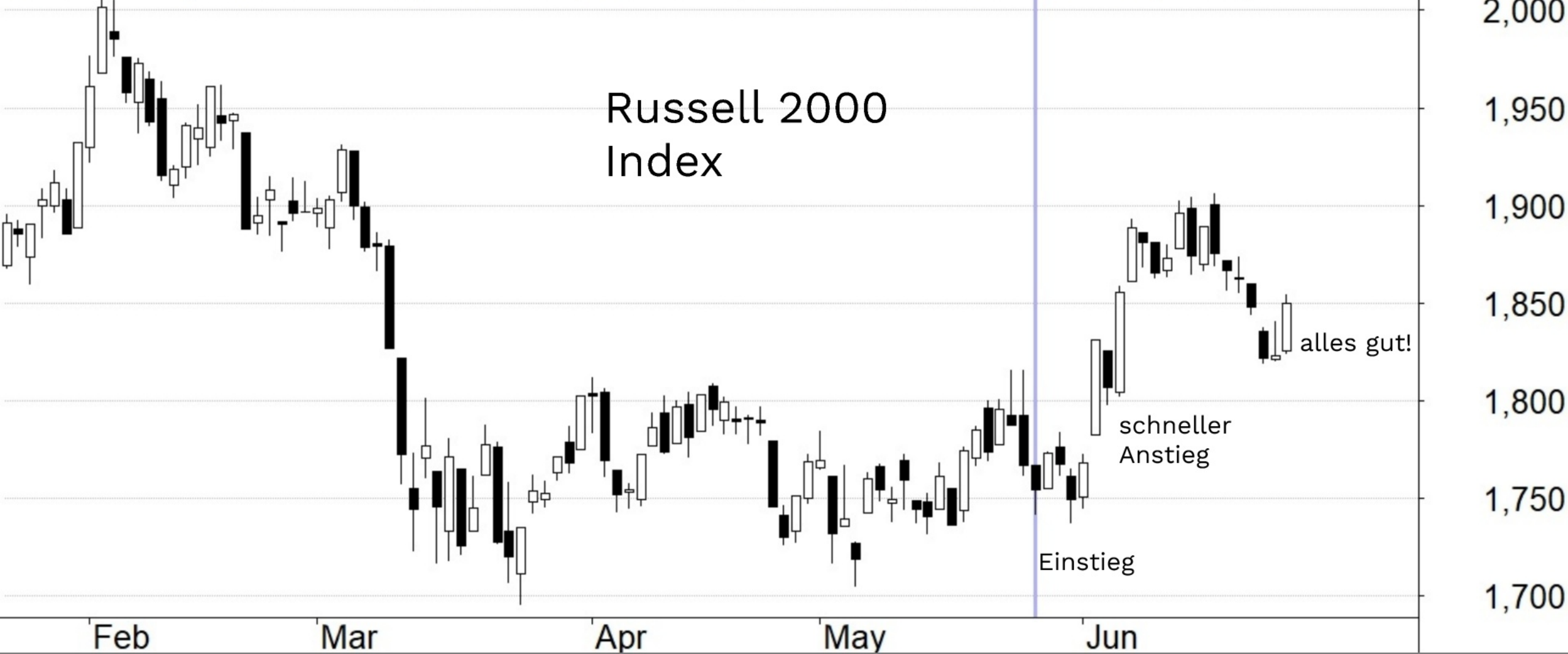
MTD

1M

YTD

1Y

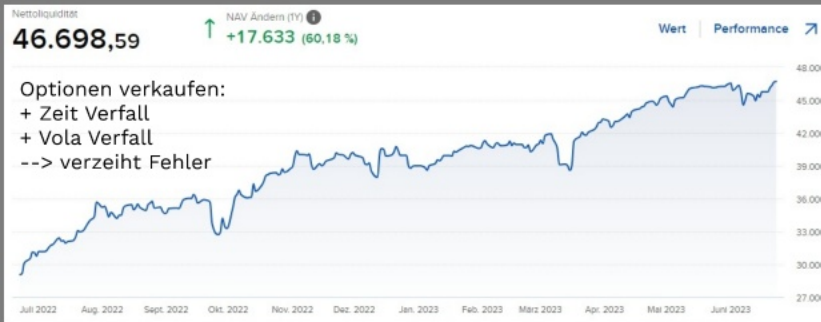
\$RUT - Daily 25.05.2023 Open 1767.1, Hi 1767.1, Lo 1741.24, Close 1754.6 (-0.7%)



2,000
1,950
1,900
1,850
1,800
1,750
1,700

Strategie 3: Optionen

Regeln



Backtest

Beispiel

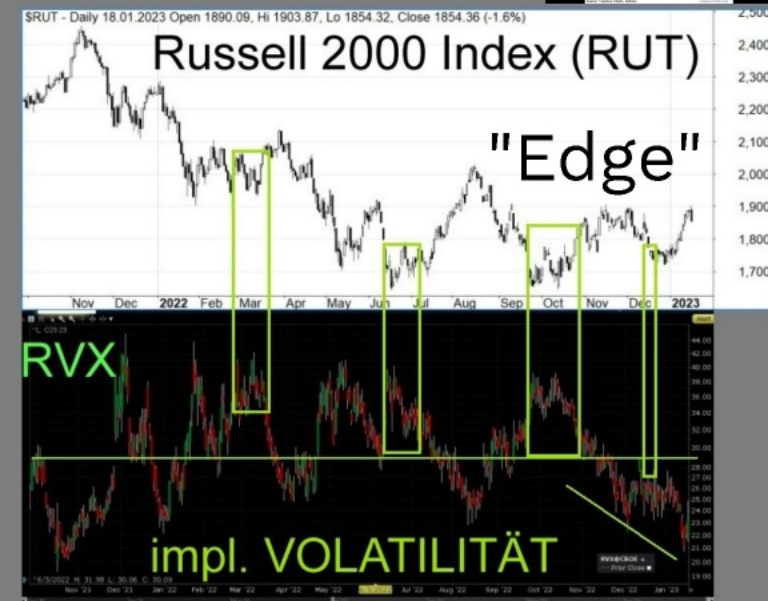


- Entry: Verkaufte Strangle (d.h. Call und Put Option)
- Laufzeit (DTE) 50-70 Tage
- Delta 6-8
- Wichtig: welcher Markt (Implizierte Vola hoch!)
- Exit: Kursziel 60%, Stop -250%
- Margin < 50%

Vola aktuell:



Letzter-Trade



S&P 500 is pricing in a big move and therefore option prices are expensive. A premium seller's dream.

There are also volatility indexes for other underlyings:

- Russell 2000 Index (Ticker: RVX)
- Nasdaq 100 Index (Ticker: VXX)
- Gold (Ticker: GVZ)
- Oil (Ticker: OVX)
- Treasury Bonds (Ticker: TVIX)

Interesse an einem Workshop dazu:
Videokurs + Webinar + Treffen
(Frankfurt)

Mail: info@urban-stocks.com

Interesse an einem Workshop dazu:
Videokurs + Webinar + Treffen
(Frankfurt)

Mail: info@urban-stocks.com

