

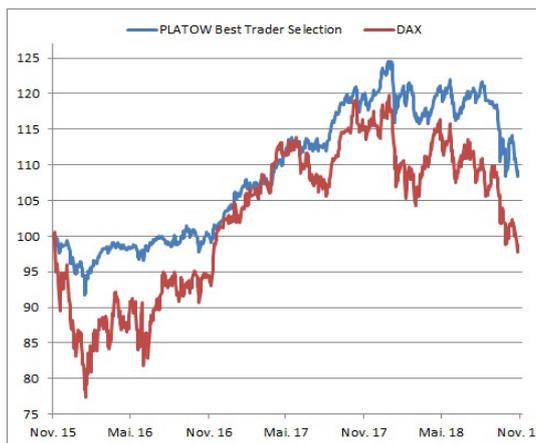
PLATOW BEST TRADER SELECTION

STRATEGIEN +++ TRADING +++ WIKIFOLIO

Nr. 45 | Mittwoch, 21. November 2018

PLATOW Best Trader Selection

Vergleich wikifolio vs. DAX; Quelle: www.wikifolio.com, vwd group



„PLATOW Best Trader Selection“ ist ein Dach-Portfolio, bestehend aus verschiedenen verbrieften Musterdepots (wikifolios), welches als Basiswert des entsprechenden Indexzertifikats von Lang & Schwarz fungiert.

Vermögensverwalter mit 100% Cash

— Unser Dachwikifolio **PLATOW Best Trader Selection** hat sich dem erneuten Schwächeanfall der Börsen leider auch in den vergangenen Tagen nicht entziehen können. Im Vergleich zur Vorwoche ist der Wert unseres Portfolios um weitere 2,0% gesunken. Die Gesamtpformance seit dem Start im November 2015 beträgt damit jetzt noch rund 9%. Der **DAX** hat in diesem Zeitraum allerdings auch knapp 2% verloren.

Ein Profiteur der jüngsten Aktienmarkt-Turbulenzen war der Trader **Christian Nüchter**, dessen wikifolio **Earnings Per Share Surprise** Trader auf Wochensicht 4,3% zulegen konnte. Der Trader hatte Mitte Oktober nahezu alle Aktien aus seinem Depot entfernt und wenige Tage später die Hälfte des Kapitals in einen Exchange Traded Funds (ETF) auf den **Short-DAX** investiert. Anfang November stockte er die Position dann weiter auf, so dass das wikifolio fast komplett aus einem jeden Tag eins zu eins an fallenden DAX-Notierungen partizipierenden ETF bestand. Gestern wurde die Position mit einem Gewinn von 4,1% aufgelöst. Ebenfalls im Plus (1,3%) liegt das wikifolio **Riu Trading** mit Hebel von **Walter Peters**, der auf einen sehr hohen Cashbestand setzt und daneben immer mal wieder kleinere Einzeltrades absetzt.

STAMMDATEN

ISIN	DE000LS9HX66
Erstellungsdatum	26.11.2015
Erstmission	26.02.2016
Investiertes Kapital	2 501 102 Euro

KENNZAHLEN

Indexstand	109,00
Performance seit Beginn	+9,0%
Performance seit Erstmission	+14,0%
Performance seit Jahresbeginn	-9,3%
Performance 1 Jahr	-8,1%
Performance 6 Monate	-9,6%
Performance 3 Monate	-8,5%
Performance 1 Monat	-2,9%
52-Wochen-Hoch	124,70
Maximaler Verlust (bisher)	-13,5%
Sharpe Ratio	-1,0

Zumindest stabil halten können sich momentan die beiden wikifolios **Trendfollowing Deutschland** von **Christoph Klar** und **Dt. Aktien-Momentum-Protect** von der **GFA Vermögensverwaltung**, bei denen die Trader jeweils schon etwas länger 100% Liquidität vorhalten. Die unabhängigen Vermögensverwalter aus Baden-Württemberg haben sich grundsätzlich auf quantitative und damit regelbasierte Anlagestrategien fokussiert. In ihrem wikifolio investierten sie das Kapital immer in die ca. 20 Einzeltitel mit dem stärksten Momentum. Als Anlageuniversum diente dabei ursprünglich der **HDAX**, der nach den Indexumstellungen der **Deutschen Börse** mittlerweile aber um den **SDAX** erweitert wurde.

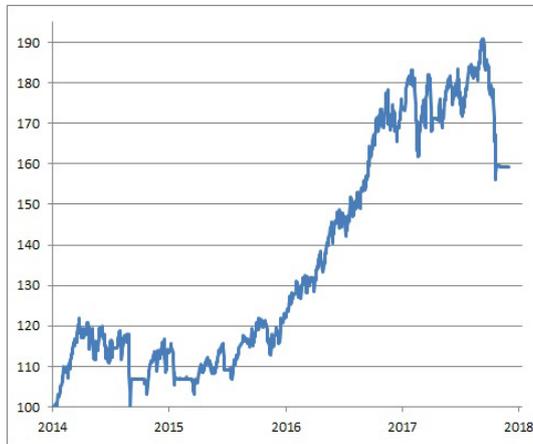
Die Anzahl der Werte resultiert aus den selbst aufgelegten Vorgaben der Anlageprofis, dass der „Risikobewirtschaftung“ ein hoher Stellenwert zukommt. „Weniger Titel würden die Rendite zwar hebeln, gleichzeitig aber auch die Volatilität erhöhen“, erklärt **Werner Krieger** auf unsere Nachfrage. Zudem wird die (bei Neuaufnahme nahezu identische) Gewichtung der einzelnen Werte auf maximal 8% begrenzt, damit es nicht zu Klumpenrisiken kommt. Hebelprodukte werden nicht verwendet, es handelt sich um ein reines Aktienportfolio.

Wichtiger Bestandteil der Strategie ist darüber hinaus eine selbst entwickelte Börsenampel, die bei den Vermögensverwaltern schon seit 5 ½ Jahren live im Einsatz ist. Ob die

Ampel auf Grün oder Rot steht, hängt von verschiedenen Sentiment-Indikatoren wie zum Beispiel Volatilitäts-Indizes,

wikifolio Dt. Aktien-Momentum-Protect

Angaben indiziert; Quelle: www.wikifolio.com



der Marktbreite oder Trendfolg-Indikatoren ab. Auch hier gibt es wieder ein festes Regelwerk, welches klar vorgibt, ob das

Kapital zu 100% in Aktien oder Cash investiert sein soll. Das bislang letzte Signal gab es am 12. Oktober, woraufhin alle Aktien aus dem Depot verkauft wurden. Vorbildlich ist neben der professionellen Umsetzung des Regelwerks auch die Transparenz. Auf der Homepage werden zum Beispiel die Performance-Daten für jedes Jahr und jeden einzelnen Monat angezeigt. **Nachdem in den Jahren 2015 bis 2017 Pluszeichen von 13,9%, 7,8% und 39,9% generiert wurden, liegt das wikifolio im laufenden Jahr mit 8,1% im Minus.** Ursächlich dafür waren die Verluste im September und Oktober, die sich auf rund 16% summiert haben, bevor dann vor rund sechs Wochen der Ausstieg aus dem Markt erfolgte.

Seit dem Start des wikifolios Ende 2014 wurde so eine Performance von 58% erzielt, während der HDAX nur auf ein Plus von 22 Prozent kommt. Der maximale Drawdown konnte in dieser Phase auf unter 20% begrenzt werden. Nach der Emission des Indexzertifikats auf dieses wikifolio zur Mitte des vergangenen Jahres steht einem Minus von 7% beim HDAX (SDAX minus 4%) ein Plus von immerhin 11% bei dem Momentum-Ansatz gegenüber. **Wir mögen solche regelbasierten Ansätze, gerade wenn sie (wie hier der Fall) professionell getestet und danach auch umgesetzt werden.** ■



PLATOW BEST TRADER SELECTION WIKIFOLIO

Der Großteil der Depotwerte verbucht auf Wochensicht ein Minus. Die Verluste reichen dabei bis zu einem Wert von 6,7% (MidTermAlpha).

Stück	ISIN	wikifolio-Zertifikat	Kaufdatum	Kaufpreis	Jetziger Kurs	Gesamtwert	Gewinn/Verlust	Depotbeitrag
45	DE000LS9EMD6	Special Investments 1	01.12.2015	186,93 €	207,92 €	9 356,45 €	+11,2%	+0,94%
35	DE000LS9CAV7	Goldesel-Trading	01.12.2015	201,06 €	223,77 €	7 831,78 €	+11,3%	+0,79%
30	DE000LS9DLQ2	Regel Nr. 1: Kein Geld verlieren	01.12.2015	166,48 €	186,92 €	5 607,66 €	+12,3%	+0,61%
20	DE000LS9BZW4	All in One	01.12.2015	243,40 €	244,02 €	4 880,48 €	+0,3%	+0,01%
12	DE000LS9ASNO	Earnings Per Share Surprise Trader	01.12.2015	206,74 €	276,37 €	3 316,44 €	+33,7%	+0,84%
40	DE000LS9HFZ6	Carpe diem Aktientrading	27.01.2016	168,03 €	216,67 €	8 666,64 €	+28,9%	+2,03%
24	DE000LS9DPK6	Tradingchancen deutsche Aktien	27.01.2016	141,30 €	153,04 €	3 672,84 €	+8,3%	+0,29%
48	DE000LS9HZ72	Abacus	15.03.2016	147,08 €	199,72 €	9 586,42 €	+35,8%	+2,60%
12	DE000LS9BNL3	Spezialwerte	23.05.2016	188,06 €	251,51 €	3 018,07 €	+33,7%	+0,78%
13	DE000LS9EQQ9	Szew Grundinvestment	23.05.2016	178,82 €	182,23 €	2 369,03 €	+1,9%	+0,05%
20	DE000LS9ALA2	MidTermAlpha	02.08.2016	291,66 €	307,46 €	6 149,18 €	+5,4%	+0,32%
30	DE000LS9HNU1	Aktien-Werte First	16.08.2016	160,63 €	238,60 €	7 157,97 €	+48,5%	+2,35%
19	DE000LS9JTR0	TSI Trendstärke mit Börsenampel	20.12.2016	133,88 €	155,43 €	2 953,15 €	+16,1%	+0,40%
14	DE000LS9GFJ2	Growth Investing Europa + USA	20.12.2016	182,94 €	205,39 €	2 875,52 €	+12,3%	+0,31%
26	DE000LS9DVS7	Riu Trading mit Hebel	04.07.2017	212,61 €	201,96 €	5 250,96 €	-5,0%	-0,25%
22	DE000LS9BYB1	Special Situations long/short	04.07.2017	259,93 €	235,21 €	5 174,60 €	-9,5%	-0,49%
34	DE000LS9K4K3	Trendfollowing Deutschland	02.10.2017	124,53 €	120,40 €	4 093,53 €	-3,3%	-0,12%
29	DE000LS9JU67	Peak Power	15.02.2018	281,46 €	285,94 €	8 292,17 €	+1,6%	+0,11%
26	DE000LS9LLQ5	Dt. Aktien-Momentum-Protect	01.10.2018	177,50 €	158,10 €	4 110,70 €	-10,9%	-0,43%
Verfolgen Sie die Entwicklung des Dachwikifolios unter wikifolio.com/de/de/w/wfplatow01			WERTPAPIERBESTAND CASH DEPOTWERT	104 363,58 Euro 4 448,58 Euro 108 812,16 Euro	KURSE VOM 21.11.18 (NACHMITTAGS, STUTTGART) PERFORMANCE SEIT DEM START (26.11.15):		+8,8%	