



Ich habe mir in 2024 mal die Mühe gemacht einen LURO-Aktien-Index zu erstellen (LURO-Aktien-Index A).

Ausgehend von den aktuell 271 Aktien wurde für jeden Handelstag ab dem 01.01.2000 die durchschnittliche Tagesperformance aller Aktien berechnet. Aktien, die zum entsprechenden Berechnungsdatum noch nicht an der Börse gelistet waren, wurden dann natürlich nicht berücksichtigt, d.h. zu Beginn der Index-Berechnung standen 215 Aktien für die Berechnung des Index zur Verfügung.

Um die relative Stärke der Aktien bei Index-Berechnung zu berücksichtigen, wurden 3 weitere LURO-Indices berechnet:

F 21: es werden nur Aktien in der durchschnittlichen täglichen Performance-Berechnung berücksichtigt, die über dem 21er SMA notieren (F 21 für Filter SMA 21)

F 50: es werden nur Aktien in der durchschnittlichen täglichen Performance-Berechnung berücksichtigt, die über dem 50er SMA notieren (F 50 für Filter SMA 50)

F 200: es werden nur Aktien in der durchschnittlichen täglichen Performance-Berechnung berücksichtigt, die über dem 200er SMA notieren (F 200 für Filter SMA 200)

In der Summe sind es also 4 Indices, die mit der Performance des S&P 500 sowie untereinander verglichen werden.

Die nachfolgende Auswertung umfasst die Daten vom 31.12.1999 bis 03.01.2025.

LURO-Aktien-Indices vs. S&P 500					
True Time-Weighted Rate of Return 421,64%	True Time-Weighted Rate of Return 2.991,49%	True Time-Weighted Rate of Return 2.070,16%	True Time-Weighted Rate of Return 1.161,31%	True Time-Weighted Rate of Return 294,52%	True Time-Weighted Rate of Return
ca. Rendite 6,82%	ca. Rendite 14,69%	ca. Rendite 13,08%	ca. Rendite 10,66%	ca. Rendite 5,64%	ca. Rendite
Maximaler Drawdown 29,18%	Maximaler Drawdown 15,33%	Maximaler Drawdown 15,18%	Maximaler Drawdown 15,56%	Maximaler Drawdown 68,91%	Maximaler Drawdown
Maximaler Drawdown Dauer 1446 Tage	Maximale Drawdown Dauer 827 Tage	Maximaler Drawdown Dauer 808 Tage	Maximaler Drawdown Dauer 918 Tage	Maximale Drawdown Dauer 9131+ Tage	Maximale Drawdown Dauer

Jahresrenditen Index A		Jahresrenditen Index F21		Jahresrenditen Index F50		Jahresrenditen Index F200		Jahresrenditen S&P 500	
	LURO-Ak...chmark)		LURO-Ak...chmark)		LURO-Ak...chmark)		LURO-Ak...chmark)		S&P 500...nchmark)
0	36,2	0	257,4	0	181,2	0	117,1	0	-3,0
1	21,0	1	62,9	1	56,1	1	36,9	1	-8,2
2	-15,6	2	10,8	2	9,8	2	2,1	2	-35,6
3	4,8	3	-1,3	3	-2,0	3	-0,8	3	4,9
4	4,4	4	5,1	4	3,8	4	1,9	4	1,1
5	22,5	5	28,6	5	27,5	5	24,9	5	18,9
6	-2,5	6	-1,5	6	-1,8	6	-2,7	6	1,8
7	-6,2	7	-1,2	7	-2,2	7	-3,6	7	-7,4
8	-1,9	8	25,7	8	25,6	8	22,5	8	-34,9
9	10,6	9	7,0	9	6,3	9	10,1	9	19,3
10	17,3	10	14,8	10	14,7	10	13,9	10	21,6
11	6,5	11	9,8	11	9,2	11	8,5	11	3,3
12	4,3	12	2,9	12	2,9	12	2,3	12	11,2
13	5,2	13	0,1	13	0,0	13	0,5	13	24,0
14	18,3	14	18,4	14	18,1	14	17,6	14	26,5
15	13,3	15	16,4	15	16,0	15	15,2	15	10,7
16	8,6	16	7,9	16	8,1	16	7,7	16	13,1
17	-7,3	17	-9,0	17	-9,1	17	-9,0	17	5,0
18	5,2	18	9,2	18	8,8	18	7,5	18	-1,8
19	9,6	19	5,9	19	6,2	19	6,7	19	31,4
20	-3,1	20	-2,2	20	-1,9	20	-1,3	20	6,4
21	14,6	21	12,5	21	12,4	21	11,9	21	37,5
22	5,5	22	10,7	22	10,3	22	9,8	22	-14,5
23	1,1	23	0,1	23	0,4	23	0,2	23	19,9
24	10,7	24	10,0	24	9,8	24	9,5	24	31,2
25	1,0	25	1,0	25	0,9	25	0,9	25	-7,9

Was auf die Schnelle auffällt ist, dass die Variante mit dem Filter SMA 21 die höchste Rendite mit 14,69 % hat und das bei einem maximalen Drawdown von nur 15,33 %.

Der S&P 500 dagegen liegt bei der Rendite bei 5,64 % mit einem maximalen Drawdown von 68,91 % - aua!

Es scheint also Sinn zu machen, die relative Stärke bei der Kauf- und Verkaufsentscheidung mit einfließen zu lassen.

Aber: sogleich stellen sich auch weitere Fragen:

- um die relative Stärke zu berücksichtigen, muss man in der F 21-Variante täglich die Aktien überwachen, was 'ne ganze Menge Arbeit bedeutet
- Transaktionskosten sind in der Performance der F 21-Variante ebenfalls nicht berücksichtigt, werden sich aber auf die Performance auswirken
- wie passt eine F 21-Variante zu den persönlichen Möglichkeiten usw.

Es ist also gar nicht so einfach, anhand der oben aufgeführten Daten daraus mal eben eine Strategie abzuleiten. Hier muss man noch tiefer in die Materie eintauchen.

Aktuell verfolge ich die Idee nicht weiter, weil mir die Zeit fehlt.

Ideen und Kritik zu Verbesserung sind daher herzlich willkommen.

👉 Let's rock the Wall Street and may the force of money be with you! 🤘