BEISPIELBERICHT

Real Markets | PRO | ANALYSEBERICHT

ERGEBNIS: NIEDRIGES RÜCKGANGSRISIKO — im Stichprobenzeitraum verlor ein Portfolio mit heutiger Zusammensetzung bis zu 2,5% vom Höchststand (etwa 245,09 EUR beim heutigen Wert); an 1 von 20 Tagen verlor das Portfolio mehr als 36,23 EUR (0,4% des Werts). Hauptquelle der Verluste an schlechten Tagen: USD (77 %).

NIEDRIG

Im Vergleich mit Referenzportfolios (größter Rückgang an denselben Tagen): Ihr Portfolio 2,5%; 100 % BTC: keine Daten; 60/40: keine Daten; gleiche Gewichte 3,2%.

Was jetzt zu tun ist: Prüfen Sie, ob ein Rückgang von etwa 2,5% (etwa 245,09 EUR) und die Verluste an schlechten Tagen zu Ihrer Risikotoleranz passen; USD trägt am meisten zu den Verlusten an schlechten Tagen bei. Der Bericht beschreibt die Historie der Stichprobe und ist keine Kauf- oder Verkaufsempfehlung.

Demonstrationsdaten: EZB-Referenzkurse (USD, GBP, JPY in EUR) und ein Beispielportfolio von 10.000 EUR. Dies ist eine Kurzfassung eines Real-Markets-Pro-Berichts — der vollständige Bericht enthält zusätzlich Umfang, alle Messwerte, Befunde, Datenquelle und die Dokumentkennung. Keine Anlageberatung.

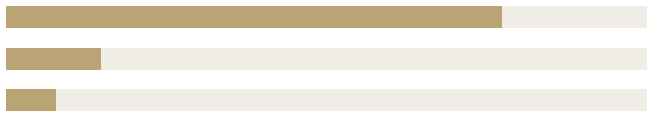
IHR PORTFOLIO

Portfoliowert: 10.000 EUR (von Ihnen angegeben); Stichprobenzeitraum: 2025-09-11 – 2026-11-13; Beobachtungen: 300.
Wertänderung im Stichprobenzeitraum: +3,5% (+350,78 EUR).
Größter Rückgang vom Höchststand: 2,5% (245,09 EUR beim heutigen Wert).
Annualisierte Volatilität: 3,5%; schlechtester einzelner Tag der Stichprobe: -0,7%.
Ein schlechter Tag: An den schlechtesten 5 % der Tage der Stichprobe überstieg der Verlust 36,23 EUR (0,4%); im Mittel 49,18 EUR an solchen Tagen.
Größte Verlustquellen an schlechten Tagen: USD 77%; JPY 15%; GBP 8%.
Schätzunsicherheit: schlechter Tag (95 %) 36,23 EUR (95-%-Konfidenzintervall: 26,47–44,26 EUR; im 95-%-Rand liegen 16 von 300 Tagen); mittlerer Verlust an schlechten Tagen 49,18 EUR (95-%-Konfidenzintervall: 39,73–55,91 EUR); 1 von 100 Tagen: 55,36 EUR (95-%-Konfidenzintervall: 45,58–59,44 EUR; im 99-%-Rand liegen 4 von 300 Tagen).
Vergleich mit einfachen Referenzportfolios an denselben Tagen. Ihr Portfolio: Rückgang 2,5%, Sharpe -0,01.
100 % BTC: keine Daten — die Daten enthalten keine BTC-Reihe; dieser Vergleich wurde nicht durchgeführt.
60/40 Aktien/Anleihen: keine Daten — die Daten enthalten weder eine Aktien- noch eine Anleihereihe; dieser Vergleich wurde nicht durchgeführt.
Gleiche Gewichte Ihrer Positionen: größter Rückgang 3,2%, annualisierte Volatilität 3,4%, Sharpe -0,29; Ihr Portfolio fiel um 0,8% Punkte weniger; Tracking Error 1,1% pro Jahr.
Die Zahlen beschreiben ein Portfolio mit der heutigen, nach jedem Tag der Stichprobe wiederhergestellten Zusammensetzung. Dies ist weder Ihre Kontohistorie noch eine Prognose.

BEISPIELBERICHT

Real Markets | PRO | ANALYSEBERICHT

ANTEIL DER ANLAGEN AM VERLUST AN SCHLECHTEN TAGEN



Anteil = Beitrag der Anlage zum durchschnittlichen Portfolioverlust in den schlechtesten 5 % der Beobachtungen; ein negativer Wert minderte Verluste. Beträge in TXT und JSON.

GRENZEN DIESES BERICHTS

1. Die Zahlen beschreiben die Historie der Stichprobe (2025-09-11 – 2026-11-13); sie sind keine Prognose — künftige Rückgänge und Verluste können größer sein.
2. Portfolioergebnisse verwenden die heutige, nach jedem Tag wiederhergestellte Zusammensetzung; dies ist nicht Ihre Kontohistorie.
3. Dies ist eine Informationsanalyse, keine Anlageberatung: Der Bericht sagt nicht, was zu kaufen oder zu verkaufen ist oder wie das Portfolio zu ändern ist.
4. Sie haben die Daten geliefert; ihre Quelle wurde nicht unabhängig bestätigt.
5. Die vollständige Liste der erfassten Einschränkungen (28) steht im technischen Anhang der TXT-Datei und in der JSON-Datei.