

Risiko-Rendite-Tabelle nach Gerd Kommer

Das Weltportfolio: Mischung risikoarm und risikoreich Geldanlage

Tabelle 8: Kennzahlen für Risiko und Rendite von elf Portfolios aus global diversifizierten Aktien (ohne → Faktorprämien) und einer »risikofreien« Anlage auf der Basis von Renditen in Euro von 1970 bis 2017 (48 Jahre)

Portfolio-Nr.	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
Risikobehafteter Portfolioteil (Aktien)	100%	90%	80%	70%	60%	50%	40%	30%	20%	10%	0%
Risikoarmer PF-Teil (zinstragende Anlage)	0%	10%	20%	30%	40%	50%	60%	70%	80%	90%	100%
Maximaler kumulativer Verlust, nominal	-53%	-48%	-44%	-38%	-33%	-27%	-20%	-14%	-8%	-3%	-2%
Längste NRP in Jahren, nominal	12,3	11,8	7,4	7,0	6,2	5,3	4,9	4,6	2,0	1,3	2,1
Erwartete Rendite, real	5,0% p.a.	4,7% p.a.	4,4% p.a.	4,0% p.a.	3,7% p.a.	3,3% p.a.	2,9% p.a.	2,4% p.a.	2,0% p.a.	1,5% p.a.	1,0% p.a.

Quelle: Gerd Kommer, Souverän Investieren für Einsteiger, S. 119