



DEFINED RISK STRATEGIEN

VS.

S&P 500 BUY & HOLD

Performance eines Depots mit allen kurzfristigen Strategien (ohne 0 DTE) im Vergleich zu einem Buy & Hold-Investment in den S&P 500

BACKTEST



Backtest-Ergebnisse seit Auflage der Daily-Optionen
(16.05.2022 - 30.09.2026)

- Underlying: SPX und QQQ
- Kapitalbedarf insgesamt: 55.500 \$
- Gewinn gesamt: +165.279 \$
- Rendite auf das eingesetzte Kapital: +37,1 % p.a.
- MAR-Ratio: 14,5

Dates:
from: May 16, 2022
to: September 30, 2026

P/L
\$165,279

CAGR
37.1%

Max Drawdown
-2.6%

MAR Ratio
14.5

Sharpe
3.87

Sortino
7.92

Total Premium
\$854,957

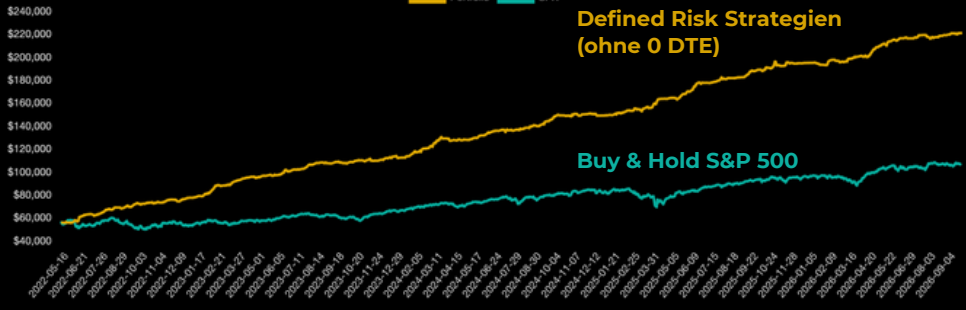
Capture Rate
19.3%

Starting Capital
\$55,500

Ending Capital
\$220,779

Daily Net Liquidity

Portfolio SPX



Quelle: optionomega.com