

iqX Systematic-Investmentmodell V1

Basisdaten		Beschreibung	
Outperformance	1.293 % (12,48 % p.a.)	1. Dividende (15% LONG - 10% SHORT)	
Transaktionen	2107 (111,3 p.a.)	- 1Aa Dividende Momentum DivTrend DAX-Aktien (5%)	
Benchmark	DAX P	- 1Ab Dividende Mom DivTrend Sommer ShortDAX (5%)	
	Benchmark	- 1Ba Dividenden Momentum MacroTrend DAX-Aktien (5%)	
		- 1Bb Dividenden Mom MacroTrend mit ShortDAX-ETF(5%)	
		- 1Ca Dividendestrategie mit 5 Dow-Aktien (5%)	
Kapital		2. LowRisk (10% LONG - 0% SHORT)	
Start 01/2000	5.000.000 EUR	- 2Aa LowBeta +Trend 0 10 NASDAQ100-Aktien (10%)	
Ende 11/2018	8.337.758 EUR	3. Relative Stärke (30% LONG - 20% SHORT)	
		- 3Aa Momentum MacroTrend 5 HDAX-Aktien (10%)	
		- 3Ab MacroTrend HDAX mit ShortDAX-ETF (10%)	
		- 3Ba GlobalTrendfilter Momentum 5 HDAX-Aktien (10%)	
		- 3Bb GlobalTrendfilter mit ShortDAX-ETF (10%)	
		- 3Ca Momentum+Trends NASDAQ100-Aktien (10%)	
		4. Trendfolge (10% LONG - 0% SHORT)	
		- 4Aa Globale Trendfolge DC mit MSCI World (5%)	
		- 4Ba Globale Trendfolge EM mit MSCI EM ETF (5%)	
		- 4Ca TurtleTrend 260-130 VStopp HDAX-Aktien (5%)	
		- 4Da Trendfolge Gold mit Gold-ETF (5%)	
		5. Saisonal (10% LONG - 10% SHORT)	
		- 5Aa SAISONAL 1 Jan-Mai MDAX -ETF (5%)	
		- 5Ab SAISONAL 3 Aug-Sep ShortDAX-ETF (5%)	
		- 5Ac SAISONAL 4 Nov-Dez DAX -ETF (5%)	
		- 5Ba 16-Wochen-nur-Long DAX-ETF (5%)	
		- 5Ca MN Saisonal Jan-Sep MDAX -ETF (5%)	
		- 5Cb MN Saisonal Okt-Dez DAX -ETF (5%)	
		- 5Da MN Saisonal Jan-Sep ShortDAX -ETF (5%)	
		- 5Db MN Saisonal Okt-Dez ShortMDAX -ETF (5%)	
		Es wurden Transaktionskosten von 0,1% je Kauf und je Verkauf berücksichtigt.	
Rendite			
Rendite p.a. (geo.)	2,74 %	15,22 %	
Rendite 2017	12,51 %	20,25 %	
Rendite 2018 YTD	-12,85 %	0,70 %	
Risiko			
Maximaler Rückgang	-72,68 %	-10,39 %	
Mittlerer Rückgang	-23,30 %	-2,91 %	
Volatilität p.a.	20,57 %	9,54 %	
Längste Verlustperiode	7,31 J.	1,35 J.	
Rendite zu Risiko			
Rendite / Max. Rückgang	0,04	1,47	
Rendite / Mittel Rückgang	0,12	5,23	
Rendite / Volatilität p.a.	0,13	1,59	

