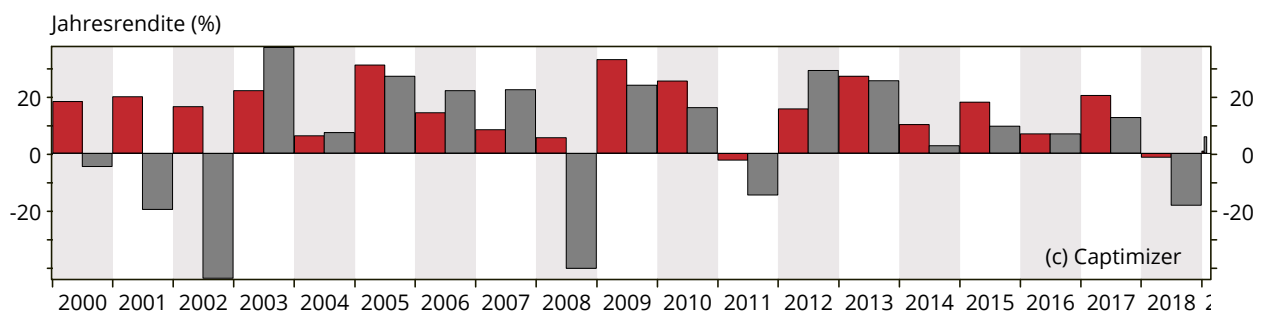
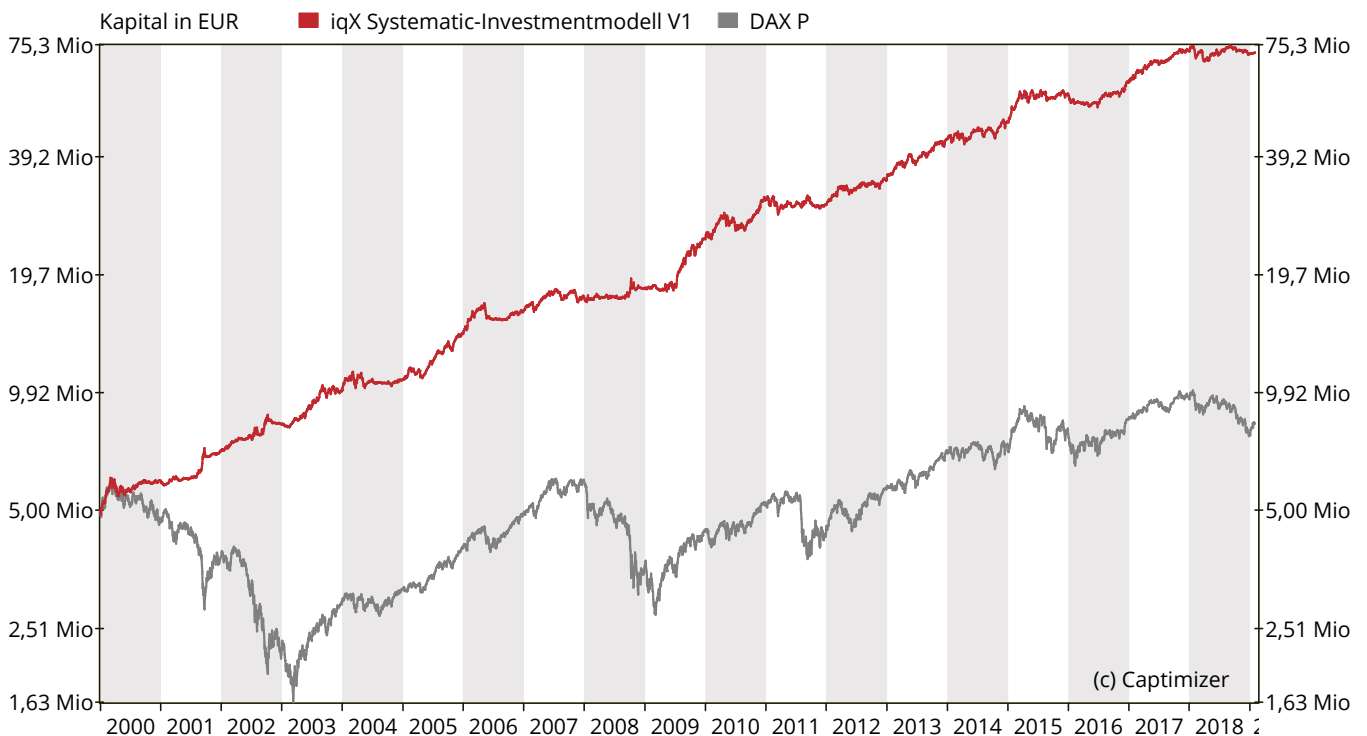


iqX Systematic-Investmentmodell V1

Basisdaten		Beschreibung	
Outperformance	1.274 % (12,32 % p.a.)	1. Dividende (15% LONG - 10% SHORT)	
Transaktionen	2117 (110,9 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 01/2019	8.275.439 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.)	2,67 %	14,99 %	
Rendite 2018	-18,26 %	-1,42 %	
Rendite 2019 YTD	5,82 %	0,80 %	
Risiko			
Maximaler Rückgang	-72,68 %	-10,31 %	
Mittlerer Rückgang	-23,27 %	-2,92 %	
Volatilität p.a.	20,58 %	9,54 %	
Längste Verlustperiode	7,31 J.	1,35 J.	
Rendite zu Risiko			
Rendite / Max. Rückgang	0,04	1,45	
Rendite / Mittel Rückgang	0,11	5,13	
Rendite / Volatilität p.a.	0,13	1,57	



iqX Systematic-Investmentmodell V1

Chance		3,5
Rendite p.a.	14,99 %	3,5
Outperformance p.a.	12,32 %	5,0
positive Monatsrenditen	64,19 %	4,0
Risiko		2,0
Maximaler Rückgang	-10,31 %	2,0
Mittlerer Rückgang	-2,92 %	1,0
Max. Verlustdauer	1,35 J.	1,0
Volatilität p.a.	9,54 %	1,5
Bequemlichkeit		2,0
Transaktionen p.a.	220,81	2,0
Handelstage p.a.	105,35	2,0
Anlagehorizont		3Jahre
Max. Verlustdauer	1,35 J.	

Max. Transaktionen im Kalenderjahr 407 (2000)

iqX Systematic-Investmentmodell V1

	Jahresrenditen (%)	Monatsrenditen (%)											
		Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez
2000	18,18	4,27	11,76	-0,03	-2,53	-2,71	1,11	2,01	3,26	1,06	-1,69	1,89	-0,79
2001	19,90	-1,91	2,49	1,40	-1,42	1,36	0,21	0,20	4,30	8,19	0,91	0,24	2,70
2002	16,33	2,01	1,44	2,72	0,84	-0,59	0,71	3,48	-1,74	10,66	-1,92	-1,34	-0,42
2003	22,01	-1,22	1,41	2,54	0,95	4,08	2,37	5,34	5,11	-4,64	5,00	-0,45	0,06
2004	6,13	6,64	2,15	-2,80	0,13	-1,71	2,59	-2,61	0,22	-0,20	-0,38	0,73	1,56
2005	30,93	2,88	2,90	-0,96	-3,53	5,87	3,50	6,48	-0,14	5,52	-2,59	5,79	2,16
2006	14,29	7,46	4,17	2,52	0,97	-4,84	-1,57	0,10	-0,13	1,30	2,14	-0,03	1,83
2007	8,25	3,07	-1,71	2,40	3,66	3,19	-0,34	0,96	-3,24	2,15	2,33	-5,67	1,62
2008	5,46	-0,94	0,54	0,72	-0,34	0,49	-0,22	-0,86	0,22	2,85	2,55	0,75	-0,35
2009	32,89	0,67	0,93	-2,71	0,66	1,58	0,12	10,08	5,07	5,72	-2,25	5,58	4,06
2010	25,31	0,69	4,10	6,58	1,68	-2,74	-2,69	-0,59	-0,83	5,18	4,10	3,89	3,93
2011	-2,53	-2,86	2,15	-3,07	1,36	1,16	-0,82	-0,54	1,24	-0,42	-1,88	0,57	0,71
2012	15,58	2,76	3,22	3,91	0,85	-2,15	0,71	3,12	-1,18	1,32	-1,13	2,58	0,77
2013	27,02	3,25	5,46	2,27	-0,24	2,07	-2,19	4,03	-0,70	4,04	3,63	1,47	1,34
2014	10,12	-0,03	3,33	-0,91	-2,44	3,82	1,24	-1,76	2,06	-0,05	0,69	4,08	-0,11
2015	17,91	7,73	5,40	2,78	-3,20	5,65	-2,76	2,49	-2,76	-0,21	1,76	2,37	-1,93
2016	6,78	-3,44	-0,85	-0,72	-1,02	0,79	0,51	4,22	-0,24	2,14	-0,31	1,96	3,81
2017	20,25	2,20	3,97	2,63	1,01	2,56	-1,40	1,54	2,18	2,21	2,11	-0,17	-0,15
2018	-1,42	1,33	-1,57	-4,72	-0,27	3,02	0,51	1,67	3,22	-0,69	-1,40	-0,13	-2,11
2019	0,80	0,80											
Mittelwert	14,71	1,77	2,70	0,77	-0,15	1,10	0,08	2,07	0,84	2,43	0,61	1,27	0,98

Einstiegsdatum	Stückzahl	Einstiegsbetrag	Ausstiegsbetrag	Gewinn/Verlust	%-Gewinn/Verlust	Transaktionskosten	Strategie	Handelsrichtung	Analysiertes Wertpapier	Umsetzungsart	Positiongröße (%)
12.02.2018	26016	703.683,27	1.012.672,70	308.285,74	43,81	703,68	2Aa LowBeta tNASDAQ	LONG	CA Inc.	Direkt	1,41
27.04.2018	14438	695.673,21	935.457,01	239.088,12	34,37	695,67	1Ca Div. 5 Dow	LONG	Merck Co. DL-,01	Direkt	1,30
30.05.2018	23459	708.945,16	866.873,98	157.219,88	22,18	708,95	1Ca Div. 5 Dow	LONG	Pfizer	Direkt	1,20
14.09.2018	34826	739.704,24	775.923,28	35.479,34	4,80	739,70	4Ca TurtleTrend	LONG	TAG Immobilien AG	Direkt	1,08
11.10.2018	8803	717.732,55	709.801,64	-8.648,65	-1,20	717,73	2Aa LowBeta tNASDAQ	LONG	Express Scripts Holding Inc.	Direkt	0,99
26.10.2018	2562	729.516,91	768.667,97	38.421,55	5,27	729,52	2Aa LowBeta tNASDAQ	LONG	O'Reilly Automotive Inc.	Direkt	1,07
30.10.2018	33634	3.614.991,33	3.862.005,17	243.398,84	6,73	3.614,99	4Da LT Gold-ETF	LONG	Gold Unze (USD)	ETF oder ETC	5,37
07.11.2018	71251	1.475.964,47	1.587.472,28	110.031,85	7,45	1.475,96	3Aa Mom+Makro HDAX	LONG	TAG Immobilien AG	Direkt	2,21
28.11.2018	36151	1.444.232,45	1.490.867,24	45.190,56	3,13	1.444,23	3Aa Mom+Makro HDAX	LONG	Innogy SE	Direkt	2,07
29.11.2018	16658	719.237,52	697.922,97	-22.033,78	-3,06	719,24	1Ca Div. 5 Dow	LONG	Coca-Cola	Direkt	0,97
04.12.2018	16684	721.817,24	716.149,94	-6.389,12	-0,89	721,82	2Aa LowBeta tNASDAQ	LONG	21st Century Fox Inc.	Direkt	0,99
27.12.2018	20527	1.412.257,60	1.610.343,15	196.673,29	13,93	1.412,26	3Aa Mom+Makro HDAX	LONG	Carl-Zeiss Meditec	Direkt	2,24
02.01.2019	16537	3.569.169,96	3.913.500,20	340.761,07	9,55	3.569,17	5Ca MN MDAX	LONG	MDAX	ETF oder ETC	5,44
02.01.2019	357034	3.585.182,44	3.362.235,03	-222.957,42	-6,22	10,00	5Da MN MDAX -ETF	SHORT	DAX P	Short ETF oder ETC	4,67
02.01.2019	63414	1.384.010,55	1.602.471,78	217.077,22	15,68	1.384,01	3Aa Mom+Makro HDAX	LONG	Dialog Semiconductor plc	Direkt	2,23
23.01.2019	2951	1.434.554,88	1.443.039,00	7.049,57	0,49	1.434,55	3Aa Mom+Makro HDAX	LONG	Puma SE	Direkt	2,00
23.01.2019	9154	723.051,58	718.131,30	-5.643,33	-0,78	723,05	4Ca TurtleTrend	LONG	Carl-Zeiss Meditec	Direkt	1,00
28.01.2019	854478	3.550.181,09	3.603.601,16	46.319,70	1,30	7.100,36	4Ba GlobalTrend EM	LONG	MSCI Emerging Markets Net	ETF oder ETC	5,01