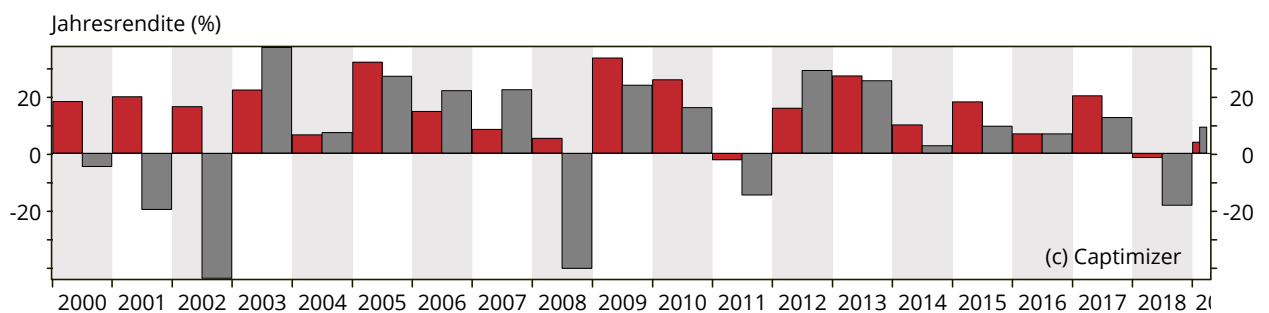
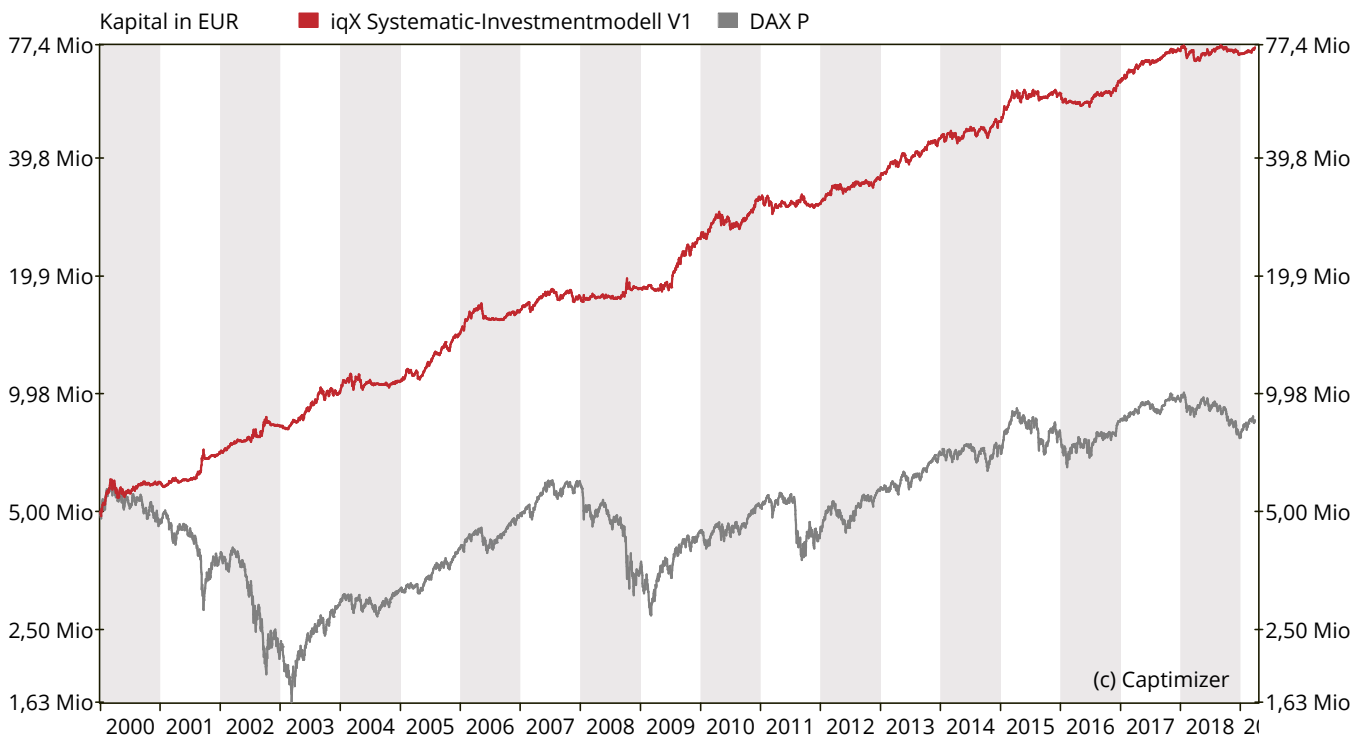


iqX Systematic-Investmentmodell V1

Basisdaten		Beschreibung	
Outperformance	1.353 % (12,38 % p.a.)	1. Dividende (15% LONG - 10% SHORT)	
Transaktionen	2152 (111,8 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 03/2019	8.536.846 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.)	2,82 %	15,20 %	
Rendite 2018	-18,26 %	-1,62 %	
Rendite 2019 YTD	9,16 %	3,90 %	
Risiko			
Maximaler Rückgang	-72,68 %	-10,29 %	
Mittlerer Rückgang	-23,21 %	-2,90 %	
Volatilität p.a.	20,50 %	9,52 %	
Längste Verlustperiode	7,31 J.	1,35 J.	
Rendite zu Risiko			
Rendite / Max. Rückgang	0,04	1,48	
Rendite / Mittel Rückgang	0,12	5,25	
Rendite / Volatilität p.a.	0,14	1,60	



iqX Systematic-Investmentmodell V1

Chance		4,0
Rendite p.a.	15,20 %	4,0
Outperformance p.a.	12,38 %	5,0
positive Monatsrenditen	64,50 %	4,0
Risiko		2,0
Maximaler Rückgang	-10,29 %	2,0
Mittlerer Rückgang	-2,90 %	1,0
Max. Verlustdauer	1,35 J.	1,0
Volatilität p.a.	9,52 %	1,5
Bequemlichkeit		2,0
Transaktionen p.a.	221,03	2,0
Handelstage p.a.	104,90	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	18,20	4,27	11,76	-0,03	-2,53	-2,71	1,11	2,01	3,26	1,07	-1,69	1,90	-0,78
2001	19,91	-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	22,24	-1,22	1,41	2,54	0,95	4,08	2,37	5,39	5,11	-4,71	5,23	-0,46	0,07
2004	6,50	6,63	2,22	-2,76	0,27	-1,63	2,79	-2,77	0,22	-0,20	-0,38	0,73	1,56
2005	31,94	2,88	2,91	-0,96	-3,46	5,97	3,52	6,50	-0,07	5,82	-2,41	5,85	2,15
2006	14,65	7,50	4,19	2,47	1,23	-4,82	-1,58	0,13	-0,12	1,30	2,14	-0,03	1,83
2007	8,39	3,07	-1,71	2,39	3,67	3,20	-0,34	0,97	-3,24	2,17	2,31	-5,57	1,62
2008	5,29	-0,95	0,54	0,72	-0,34	0,69	-0,49	-0,93	0,23	2,86	2,56	0,70	-0,34
2009	33,43	0,60	1,22	-2,78	0,65	1,62	0,23	10,10	5,12	5,69	-2,27	5,76	4,00
2010	25,84	0,82	4,16	6,89	1,65	-2,71	-2,38	-0,64	-0,52	4,94	4,03	3,51	3,97
2011	-2,41	-2,85	2,01	-2,86	1,16	1,13	-0,84	-0,29	1,25	-0,42	-1,88	0,57	0,71
2012	15,82	2,84	3,24	3,92	0,98	-2,12	0,65	3,08	-1,19	1,23	-1,14	2,71	0,77
2013	27,13	3,31	5,39	2,14	-0,10	2,17	-2,34	4,06	-0,74	4,13	3,68	1,48	1,35
2014	10,00	-0,06	3,34	-0,92	-2,49	3,83	1,21	-1,77	2,02	-0,08	0,69	4,11	-0,07
2015	18,02	7,66	5,41	2,79	-3,22	5,70	-2,73	2,52	-2,75	-0,22	1,82	2,38	-1,94
2016	6,81	-3,44	-0,85	-0,71	-1,02	0,80	0,51	4,22	-0,25	2,14	-0,31	1,96	3,81
2017	20,24	2,20	3,97	2,63	1,00	2,57	-1,40	1,56	2,18	2,21	2,09	-0,17	-0,15
2018	-1,62	1,33	-1,60	-4,73	-0,27	2,99	0,52	1,67	3,20	-0,71	-1,40	-0,13	-2,23
2019	3,90	0,83	0,23	2,81									
Mittelwert	15,03	1,78	2,59	0,88	-0,13	1,13	0,09	2,08	0,86	2,43	0,63	1,27	0,98

Einstiegsdatum	Stückzahl	Einstiegsbetrag	Ausstiegsbetrag	Gewinn/Verlust	%-Gewinn/Verlust	Transaktionskosten	Strategie	Handelsrichtung	Analysiertes Wertpapier	Umsetzungsart	Positionsgröße (%)
27.04.2018	14948	715.416,87	1.106.594,71	390.462,43	54,58	715,42	1Ca Div. 5 Dow	LONG	Merck Co. DL-,01	Direkt	1,45
30.05.2018	24119	728.890,75	911.759,63	182.139,99	24,99	728,89	1Ca Div. 5 Dow	LONG	Pfizer	Direkt	1,20
14.09.2018	35797	760.328,28	792.545,58	31.456,97	4,14	760,33	4Ca TurtleTrend	LONG	TAG Immobilien AG	Direkt	1,04
26.10.2018	2634	750.018,55	910.378,44	159.609,87	21,28	750,02	2Aa LowBeta tNASDAQ	LONG	O'Reilly Automotive Inc.	Direkt	1,20
30.10.2018	34571	3.715.700,35	3.969.767,11	250.351,06	6,74	3.715,70	4Da LT Gold-ETF	LONG	Gold Unze (USD)	ETF oder ETC	5,21
06.11.2018	13324	751.623,50	881.649,53	129.274,41	17,20	751,62	2Aa LowBeta tNASDAQ	LONG	Starbucks	Direkt	1,16
27.12.2018	21215	1.449.302,73	1.574.153,00	123.400,97	8,51	1.449,30	3Aa Mom+Makro HDAX	LONG	Carl-Zeiss Meditec	Direkt	2,07
02.01.2019	16977	3.664.134,87	4.192.114,97	524.315,96	14,31	3.664,13	5Ca MN MDAX	LONG	MDAX	ETF oder ETC	5,50
02.01.2019	366529	3.680.527,16	3.330.113,21	-350.423,96	-9,52	10,00	5Da MN MDAX -ETF	SHORT	DAX P	Short ETF oder ETC	4,37
02.01.2019	65100	1.420.807,50	1.757.700,00	335.471,69	23,61	1.420,81	3Aa Mom+Makro HDAX	LONG	Dialog Semiconductor plc	Direkt	2,31
23.01.2019	9463	742.159,43	702.154,60	-40.746,99	-5,49	742,16	4Ca TurtleTrend	LONG	Carl-Zeiss Meditec	Direkt	0,92
28.01.2019	877180	3.644.503,25	3.821.503,09	169.710,83	4,66	7.289,01	4Ba GlobalTrend EM	LONG	MSCI Emerging Markets Net	ETF oder ETC	5,02
05.02.2019	2516	744.546,28	776.902,03	31.611,21	4,25	744,55	2Aa LowBeta tNASDAQ	LONG	Charter Communications	Direkt	1,02
05.02.2019	8605	742.321,45	804.533,97	61.470,20	8,28	742,32	2Aa LowBeta tNASDAQ	LONG	Dollar Tree	Direkt	1,06
05.02.2019	24290	747.623,46	802.986,45	54.615,36	7,31	747,62	2Aa LowBeta tNASDAQ	LONG	eBay	Direkt	1,05
05.02.2019	13806	735.207,75	790.287,62	54.344,66	7,39	735,21	2Aa LowBeta tNASDAQ	LONG	Fastenal Co. DL-,01	Direkt	1,04
05.02.2019	10084	745.198,32	792.380,83	46.437,32	6,23	745,20	2Aa LowBeta tNASDAQ	LONG	Fiserv Inc. DL-,01	Direkt	1,04
05.02.2019	18490	740.556,64	821.580,81	80.283,61	10,84	740,56	2Aa LowBeta tNASDAQ	LONG	Mondelez International Inc.	Direkt	1,08
05.02.2019	7559	741.683,10	824.548,99	82.124,20	11,07	741,68	2Aa LowBeta tNASDAQ	LONG	Pepsico	Direkt	1,08
06.02.2019	6334	1.518.064,40	1.695.370,92	175.788,46	11,58	1.518,06	3Ca Mom+Trend NASDAQ	LONG	Broadcom Inc.	Direkt	2,23
06.02.2019	18368	1.473.231,53	1.697.717,21	223.012,45	15,14	1.473,23	3Ca Mom+Trend NASDAQ	LONG	Paypal Holdings Inc.	Direkt	2,23
06.02.2019	9062	1.492.216,81	1.483.756,56	-9.952,47	-0,67	1.492,22	3Ca Mom+Trend NASDAQ	LONG	Vertex	Direkt	1,95
06.02.2019	8953	1.476.016,46	1.536.834,24	59.341,76	4,02	1.476,02	3Ca Mom+Trend NASDAQ	LONG	Workday	Direkt	2,02
06.02.2019	15271	1.518.298,74	1.723.420,60	203.603,56	13,41	1.518,30	3Ca Mom+Trend NASDAQ	LONG	Xilinx Inc. DL-,01	Direkt	2,26
15.02.2019	19302	1.479.112,26	1.432.208,40	-48.382,97	-3,27	1.479,11	3Ba Mom+GT HDAX	LONG	Carl-Zeiss Meditec	Direkt	1,88
15.02.2019	55560	1.472.201,10	1.500.120,00	26.446,70	1,80	1.472,20	3Ba Mom+GT HDAX	LONG	Dialog Semiconductor plc	Direkt	1,97
15.02.2019	72725	1.482.680,94	1.717.764,50	233.600,88	15,76	1.482,68	3Ba Mom+GT HDAX	LONG	Evotec	Direkt	2,26
15.02.2019	7708	1.492.076,10	1.550.849,60	57.281,42	3,84	1.492,08	3Ba Mom+GT HDAX	LONG	MTU Aero Engines NA	Direkt	2,04
19.02.2019	70889	3.750.215,96	3.840.268,31	82.551,92	2,20	7.500,43	4AaGlobalTrend World	LONG	MSCI World Net	ETF oder ETC	5,04
20.02.2019	72722	1.502.436,52	1.717.693,64	213.754,68	14,23	1.502,44	3Aa Mom+Makro HDAX	LONG	Evotec	Direkt	2,26
20.02.2019	7620	1.468.564,50	1.533.144,00	63.110,94	4,30	1.468,56	3Aa Mom+Makro HDAX	LONG	MTU Aero Engines NA	Direkt	2,01
21.02.2019	32364	745.828,38	631.421,64	-115.152,57	-15,44	745,83	1Aa Div+Trend DAX	LONG	Deutsche Lufthansa AG	Direkt	0,83
21.02.2019	32364	745.828,38	631.421,64	-115.152,57	-15,44	745,83	1Ba Div+Makro DAX	LONG	Deutsche Lufthansa AG	Direkt	0,83
21.02.2019	53455	743.091,32	791.668,55	47.834,14	6,44	743,09	1Aa Div+Trend DAX	LONG	Deutsche Telekom AG	Direkt	1,04
21.02.2019	53455	743.091,32	791.668,55	47.834,14	6,44	743,09	1Ba Div+Makro DAX	LONG	Deutsche Telekom AG	Direkt	1,04
21.02.2019	76925	743.999,37	764.096,03	19.352,66	2,60	744,00	1Aa Div+Trend DAX	LONG	E.ON SE	Direkt	1,00

Einstiegsdatum	Stückzahl	Einstiegsbetrag	Ausstiegsbetrag	Gewinn/Verlust	%-Gewinn/Verlust	Transaktionskosten	Strategie	Handelsrichtung	Analysiertes Wertpapier	Umsetzungsart	Positionsgröße (%)
21.02.2019	76925	743.999,37	764.096,03	19.352,66	2,60	744,00	1Ba Div+Makro DAX	LONG	E.ON SE	Direkt	1,00
21.02.2019	4980	749.988,00	773.145,00	22.407,01	2,99	749,99	1Aa Div+Trend DAX	LONG	Linde PLC	Direkt	1,02
21.02.2019	4980	749.988,00	773.145,00	22.407,01	2,99	749,99	1Ba Div+Makro DAX	LONG	Linde PLC	Direkt	1,02
21.02.2019	3600	743.940,00	759.600,00	14.916,06	2,01	743,94	1Aa Div+Trend DAX	LONG	Münchener Rück	Direkt	1,00
21.02.2019	3600	743.940,00	759.600,00	14.916,06	2,01	743,94	1Ba Div+Makro DAX	LONG	Münchener Rück	Direkt	1,00
27.02.2019	7066	747.132,99	774.734,03	26.853,91	3,59	747,13	1Ca Div. 5 Dow	LONG	Chevron Corp.	Direkt	1,02
27.02.2019	9752	1.489.374,20	1.513.998,00	23.134,43	1,55	1.489,37	3Ba Mom+GT HDAX	LONG	Linde PLC	Direkt	1,99
27.02.2019	16561	746.694,59	795.863,68	48.422,39	6,48	746,69	1Ca Div. 5 Dow	LONG	Cisco Systems	Direkt	1,04
06.03.2019	11205	1.491.945,75	1.691.955,00	198.517,30	13,31	1.491,95	3Aa Mom+Makro HDAX	LONG	Nemetschek SE O.N.	Direkt	2,22
07.03.2019	63378	743.899,27	924.685,02	180.041,85	24,20	743,90	4Ca TurtleTrend	LONG	Nordex SE	Direkt	1,21
21.03.2019	6803	749.891,07	765.941,26	15.300,29	2,04	749,89	2Aa LowBeta tNASDAQ	LONG	Check Point Software Techs Ltd.	Direkt	1,01
21.03.2019	3791	747.774,75	762.749,20	14.226,68	1,90	747,77	4Ca TurtleTrend	LONG	MTU Aero Engines NA	Direkt	1,00
28.03.2019	6102	760.648,50	766.369,16	4.960,01	0,65	760,65	1Ca Div. 5 Dow	LONG	IBM	Direkt	1,01