

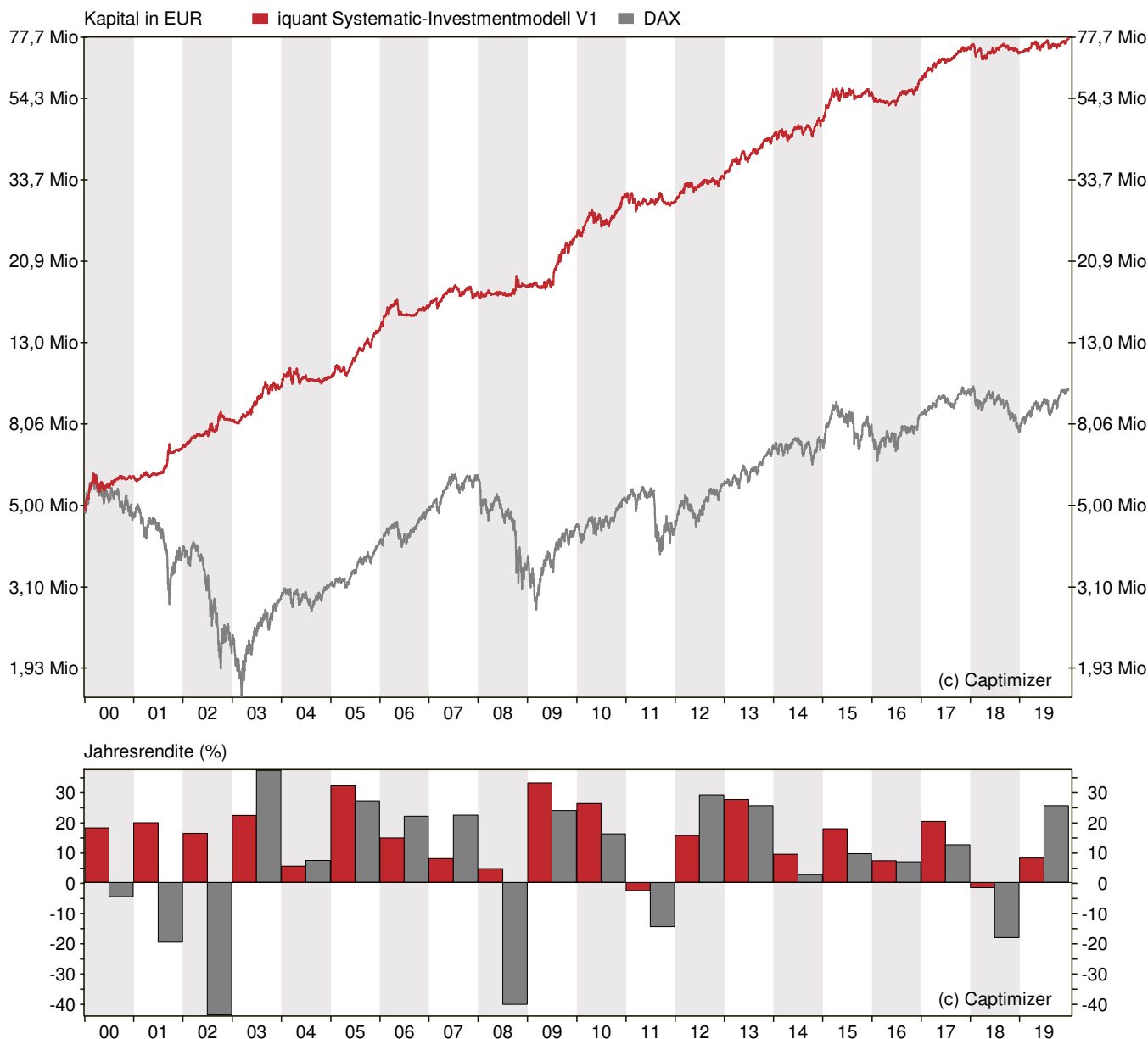
# iquant Systematic-Investmentmodell V1

Basisdaten		
Outperformance		1.340 % (11,20 % p.a.)
Transaktionen		2249 (112,4 p.a.)
Benchmark		DAX
	Benchmark	Strategie
Kapital		
Start 01/2000	5.000.000 EUR	5.000.000 EUR
Ende 12/2019	9.812.977 EUR	76.797.982 EUR
Rendite		
Rendite p.a. (geo.)	3,43 %	14,63 %
Rendite 2018	-18,26 %	-1,78 %
Rendite 2019 YTD	25,48 %	8,09 %
Risiko		
Maximaler Rückgang	-72,68 %	-10,37 %
Mittlerer Rückgang	-22,67 %	-2,92 %
Volatilität p.a.	20,28 %	9,50 %
Längste Verlustperiode	7,31 J.	1,49 J.
Rendite zu Risiko		
Rendite / Max. Rückgang	0,05	1,41
Rendite / Mittel Rückgang	0,15	5,00
Rendite / Volatilität p.a.	0,17	1,54

## Beschreibung

- Dividende (15% LONG - 10% SHORT)
  - 1Aa Dividende Momentum DivTrend DAX-Aktien (5%)
  - 1Ab Dividende Mom DivTrend Sommer ShortDAX (5%)
  - 1Ba Dividenden Momentum MacroTrend DAX-Aktien (5%)
  - 1Bb Dividenden Mom MacroTrend mit ShortDAX-ETF(5%)
  - 1Ca Dividende Strategie mit 5 Dow-Aktien (5%)
- LowRisk (10% LONG - 0% SHORT)
  - 2Aa LowBeta +Trend 0 10 NASDAQ100-Aktien (10%)
- 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%)
- 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%)
- 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%)

Bei der Simulation der Anlageergebnisse wurden Transaktionskosten von 0,1% je Kauf und je Verkauf berücksichtigt. Die Gebühren der Ziel-ETFs würden mit den aktuellen Werten ebenfalls in der Berechnung berücksichtigt.  
Die Liquidität wird im Geldmarkt zum Eonia-Geldmarktsatz angelegt.



# iquant Systematic-Investmentmodell V1

	Jahresrenditen (%)	Monatsrenditen (%)											
		Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez
2000	18,04	4,11	11,78	-0,03	-2,51	-2,71	1,11	2,01	3,26	1,05	-1,68	1,90	-0,78
2001	19,82	-1,92	2,47	1,40	-1,42	1,36	0,21	0,20	4,30	8,18	0,85	0,25	2,71
2002	16,28	1,99	1,46	2,72	0,84	-0,60	0,72	3,48	-1,76	10,65	-1,94	-1,35	-0,42
2003	22,21	-1,23	1,41	2,54	0,93	4,07	2,38	5,41	5,10	-4,72	5,24	-0,47	0,07
2004	5,38	6,63	2,21	-2,75	0,29	-1,89	2,46	-3,03	-0,03	-0,20	-0,36	0,72	1,56
2005	31,98	2,88	2,91	-0,94	-3,46	5,99	3,53	6,50	-0,10	5,82	-2,42	5,86	2,16
2006	14,73	7,49	4,19	2,47	1,23	-4,80	-1,60	0,10	-0,12	1,34	2,01	0,25	1,74
2007	7,96	3,08	-1,89	2,42	3,60	3,03	-0,32	1,01	-3,09	1,86	2,28	-5,57	1,74
2008	4,65	-1,17	0,60	0,75	-0,57	0,65	-0,16	-1,12	0,26	2,49	2,57	0,68	-0,35
2009	32,99	0,58	1,22	-2,80	0,64	1,63	0,28	10,12	5,01	5,64	-2,47	6,06	3,70
2010	26,18	0,50	4,52	6,86	1,58	-2,30	-2,41	-0,65	-0,58	4,94	4,04	3,51	3,97
2011	-2,78	-2,85	2,05	-2,94	1,19	0,90	-0,84	-0,31	1,19	-0,43	-1,89	0,56	0,69
2012	15,56	2,84	3,23	3,92	1,01	-2,25	0,66	3,06	-1,19	1,24	-1,17	2,81	0,61
2013	27,48	3,44	5,61	2,31	-0,11	1,83	-2,16	4,30	-0,86	3,99	3,67	1,76	1,04
2014	9,34	0,04	3,11	-0,89	-2,52	3,94	1,19	-1,83	1,82	0,28	0,03	4,10	-0,06
2015	17,80	7,81	5,52	2,94	-3,34	5,67	-3,12	2,53	-2,76	-0,22	1,81	2,38	-1,96
2016	7,24	-3,46	-0,85	-0,74	-1,11	0,92	0,69	4,19	-0,02	2,16	-0,29	1,96	3,80
2017	20,27	2,17	4,05	2,56	1,05	2,59	-1,41	1,54	2,18	2,21	2,08	-0,16	-0,14
2018	-1,78	1,32	-1,66	-4,74	-0,26	2,99	0,51	1,68	3,20	-0,71	-1,40	-0,13	-2,32
2019	8,09	0,79	0,23	2,83	2,67	-4,73	2,21	1,65	-1,00	0,17	-0,16	2,04	1,33
Mittelwert	15,07	1,75	2,61	0,89	-0,01	0,81	0,20	2,04	0,74	2,29	0,54	1,36	0,95