

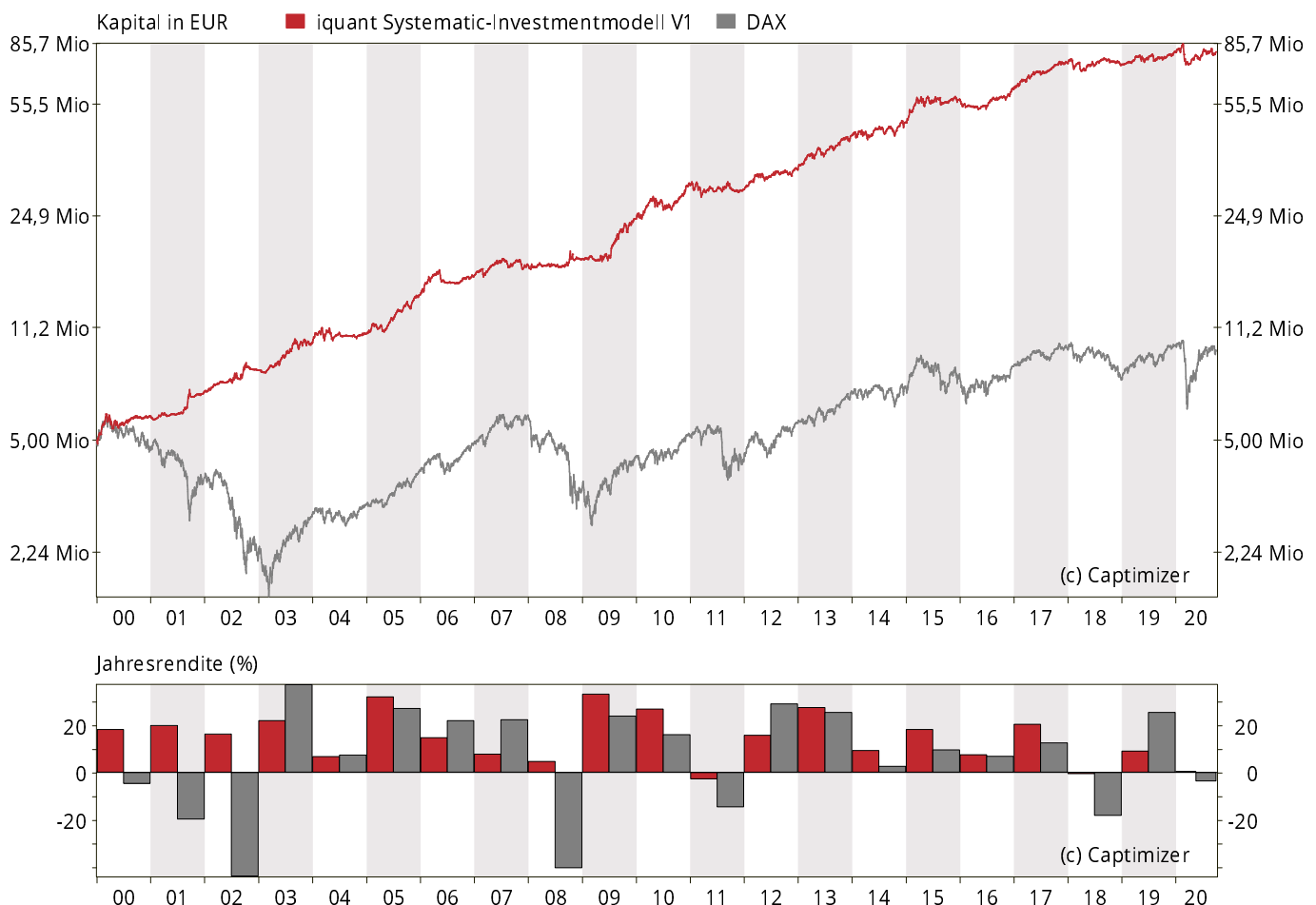
# iquant Systematic-Investmentmodell V1

Basisdaten		
Outperformance		1.425 % (11,22 % p.a.)
Transaktionen		2366 (114,0 p.a.)
Benchmark		DAX
	Benchmark	Strategie
Kapital		
Start 01/2000	5.000.000 EUR	5.000.000 EUR
Ende 09/2020	9.451.328 EUR	80.715.830 EUR
Rendite		
Rendite p.a. (geo.)	3,11 %	14,34 %
Rendite 2019	25,48 %	9,00 %
Rendite 2020 YTD	-3,69 %	0,43 %
Risiko		
Maximaler Rückgang	-72,68 %	-14,13 %
Mittlerer Rückgang	-22,28 %	-2,99 %
Volatilität p.a.	20,56 %	9,50 %
Längste Verlustperiode	7,31 J.	1,42 J.
Rendite zu Risiko		
Rendite / Max. Rückgang	0,04	1,01
Rendite / Mittel Rückgang	0,14	4,80
Rendite / Volatilität p.a.	0,15	1,51

## Beschreibung

- Dividende (1 5% LONG - 10% SHORT)
  - 1 Aa Dividende Momentum DivTrend DAX-Aktien (5%)
  - 1 Ab Dividende Mom DivTrend Sommer ShortDAX (5%)
  - 1 Ba Dividenden Momentum MacroTrend DAX-Aktien (5%)
  - 1 Bb Dividenden Mom MacroTrend mit ShortDAX-ETF(5%)
  - 1 Ca Dividendestrategie 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	18,20	4,28	11,76	-0,03	-2,51	-2,71	1,11	2,01	3,26	1,06	-1,69	1,90	-0,78
2001	19,87	-1,92	2,47	1,39	-1,38	1,36	0,21	0,20	4,30	8,19	0,89	0,24	2,70
2002	16,25	1,97	1,46	2,72	0,85	-0,60	0,71	3,48	-1,76	10,65	-1,94	-1,35	-0,42
2003	21,98	-1,23	1,40	2,58	0,93	4,10	2,28	5,30	5,10	-4,71	5,26	-0,53	0,06
2004	6,75	6,64	2,22	-2,75	0,29	-1,67	3,06	-2,80	0,21	-0,20	-0,36	0,73	1,56
2005	31,93	2,87	2,92	-0,97	-3,45	5,98	3,53	6,49	-0,09	5,81	-2,42	5,86	2,14
2006	14,71	7,49	4,18	2,47	1,22	-4,80	-1,60	0,10	-0,12	1,35	2,00	0,25	1,74
2007	7,80	3,08	-1,89	2,33	3,72	3,09	-0,43	0,86	-3,10	1,87	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	33,13	0,59	1,21	-2,81	0,65	1,62	0,28	10,12	5,00	5,64	-2,46	6,04	3,82
2010	26,85	0,54	4,51	6,97	1,72	-2,20	-2,45	-0,74	-0,61	5,11	4,01	3,65	4,03
2011	-2,82	-2,84	2,07	-2,97	1,16	1,02	-0,91	-0,37	1,20	-0,43	-1,89	0,56	0,69
2012	15,73	2,85	3,23	3,92	1,05	-2,09	0,71	3,04	-1,18	1,24	-1,24	2,80	0,61
2013	27,49	3,45	5,61	2,31	-0,11	1,83	-2,16	4,30	-0,86	3,99	3,67	1,76	1,04
2014	9,33	0,03	3,11	-0,88	-2,52	3,94	1,19	-1,83	1,82	0,29	0,05	4,10	-0,09
2015	18,21	7,92	5,40	2,79	-3,20	5,78	-3,08	2,54	-2,66	-0,11	1,76	2,36	-1,91
2016	7,54	-3,39	-0,75	-0,68	-1,07	1,01	0,78	4,20	0,01	2,19	-0,18	1,78	3,65
2017	20,37	2,10	3,81	2,60	1,07	2,73	-1,41	1,50	2,37	2,26	2,15	-0,22	-0,16
2018	-0,60	1,36	-1,50	-4,54	-0,31	3,13	0,53	1,78	3,40	-0,63	-1,24	-0,04	-2,26
2019	9,00	0,86	0,25	2,86	2,67	-4,70	2,23	1,68	-0,94	0,57	0,01	2,04	1,37
2020	0,43	-0,26	-5,86	-1,92	3,30	1,57	2,31	0,14	1,97	-0,52			
Mittelwert	14,61	1,68	2,20	0,77	0,17	0,91	0,32	1,95	0,84	2,19	0,56	1,35	0,96