

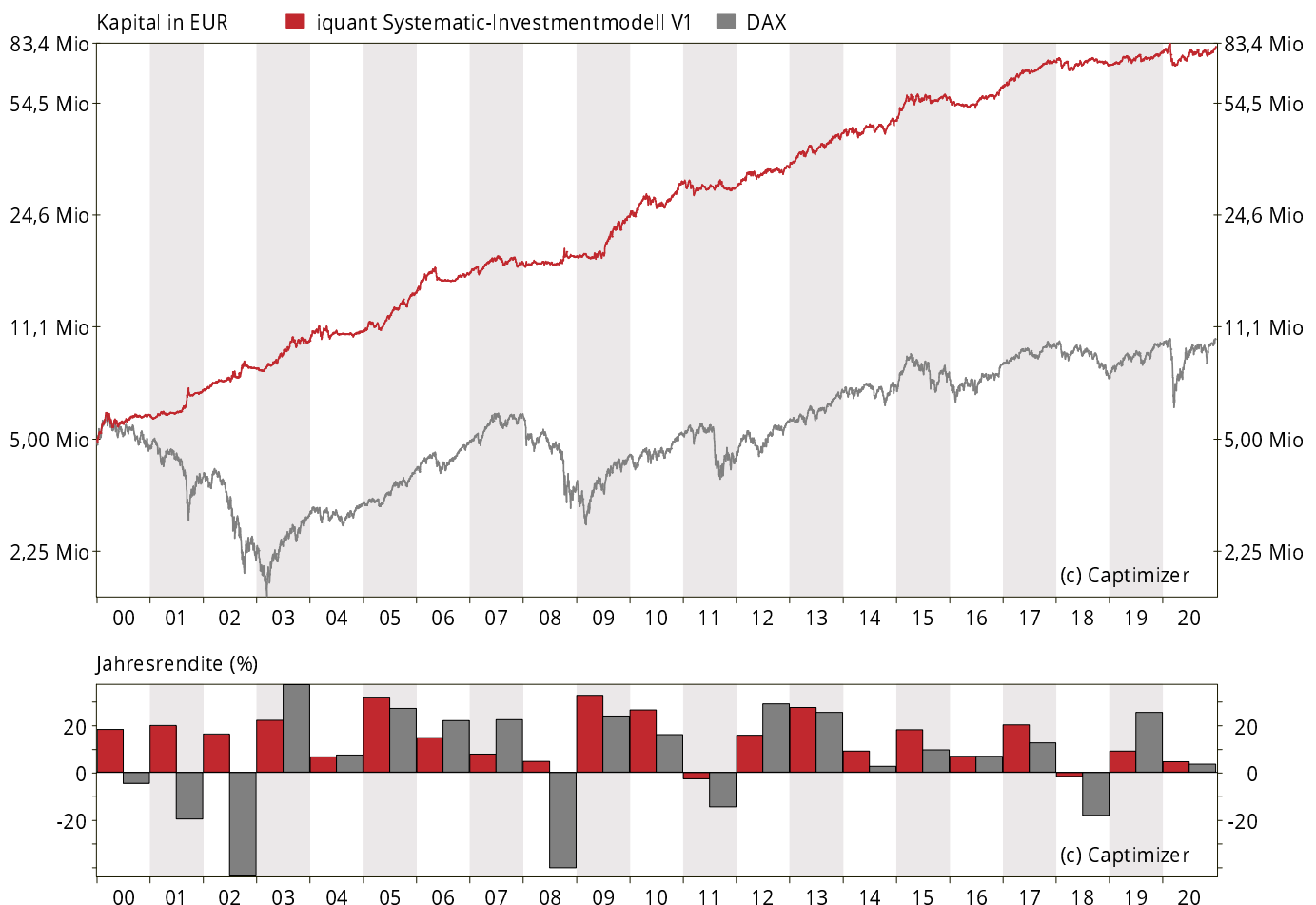
# iquant Systematic-Investmentmodell V1

Basisdaten		
Outperformance		1.427 % (10,77 % p.a.)
Transaktionen		2411 (114,7 p.a.)
Benchmark		DAX
	Benchmark	Strategie
Kapital		
Start 01/2000	5.000.000 EUR	5.000.000 EUR
Ende 12/2020	10.160.915 EUR	81.494.498 EUR
Rendite		
Rendite p.a. (geo.)	3,43 %	14,21 %
Rendite 2019	25,48 %	9,06 %
Rendite 2020 YTD	3,55 %	4,50 %
Risiko		
Maximaler Rückgang	-72,68 %	-14,52 %
Mittlerer Rückgang	-22,08 %	-3,06 %
Volatilität p.a.	20,81 %	9,50 %
Längste Verlustperiode	7,31 J.	1,49 J.
Rendite zu Risiko		
Rendite / Max. Rückgang	0,05	0,98
Rendite / Mittel Rückgang	0,16	4,64
Rendite / Volatilität p.a.	0,16	1,50

## Beschreibung

- Dividende (1 5% 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 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	18,21	4,27	11,77	-0,03	-2,51	-2,72	1,11	2,01	3,26	1,05	-1,68	1,90	-0,78
2001	19,87	-1,92	2,47	1,39	-1,39	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	0,72	3,48	-1,76	10,65	-1,94	-1,35	-0,42
2003	22,11	-1,24	1,32	2,54	0,93	4,06	2,40	5,39	5,10	-4,72	5,26	-0,48	0,10
2004	6,67	6,47	2,14	-2,75	0,43	-1,66	2,99	-2,79	0,27	-0,20	-0,36	0,73	1,56
2005	31,91	2,87	2,92	-0,97	-3,47	5,98	3,53	6,50	-0,09	5,81	-2,42	5,85	2,16
2006	14,70	7,48	4,18	2,47	1,22	-4,80	-1,59	0,10	-0,12	1,35	2,00	0,25	1,74
2007	7,80	3,08	-1,90	2,34	3,72	3,09	-0,44	0,86	-3,09	1,87	2,28	-5,57	1,74
2008	4,65	-1,17	0,60	0,76	-0,57	0,65	-0,16	-1,12	0,26	2,49	2,57	0,68	-0,35
2009	32,58	0,59	1,21	-2,81	0,65	1,63	0,27	10,03	4,93	5,59	-2,40	5,86	3,72
2010	26,42	0,52	4,68	6,86	1,74	-2,29	-2,61	-0,68	-0,58	4,94	4,05	3,52	4,05
2011	-2,76	-2,84	2,04	-2,94	1,19	0,98	-0,84	-0,36	1,20	-0,43	-1,89	0,56	0,69
2012	15,73	2,84	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	-0,10	1,83	-2,16	4,30	-0,86	3,99	3,67	1,76	1,04
2014	9,06	0,03	3,03	-0,87	-2,52	3,95	1,17	-1,85	1,75	0,24	0,07	4,06	-0,11
2015	18,04	7,76	5,52	2,77	-3,22	5,71	-3,12	2,52	-2,67	-0,19	1,89	2,42	-1,95
2016	6,89	-3,46	-0,85	-0,73	-1,11	0,92	0,69	4,19	-0,02	2,16	-0,32	1,80	3,67
2017	20,10	2,03	3,85	2,59	1,13	2,68	-1,41	1,45	2,29	2,22	2,18	-0,21	-0,21
2018	-1,74	1,38	-1,57	-4,61	-0,33	3,05	0,47	1,63	3,18	-0,76	-1,42	-0,16	-2,33
2019	9,06	0,88	0,04	2,93	2,68	-4,81	2,15	2,07	-0,92	0,71	-0,10	2,02	1,28
2020	4,50	-0,25	-5,81	-2,22	3,28	1,51	2,29	0,12	1,98	-0,53	-2,43	3,11	3,81
Mittelwert	14,64	1,65	2,19	0,75	0,17	0,88	0,30	1,96	0,82	2,17	0,41	1,42	1,08