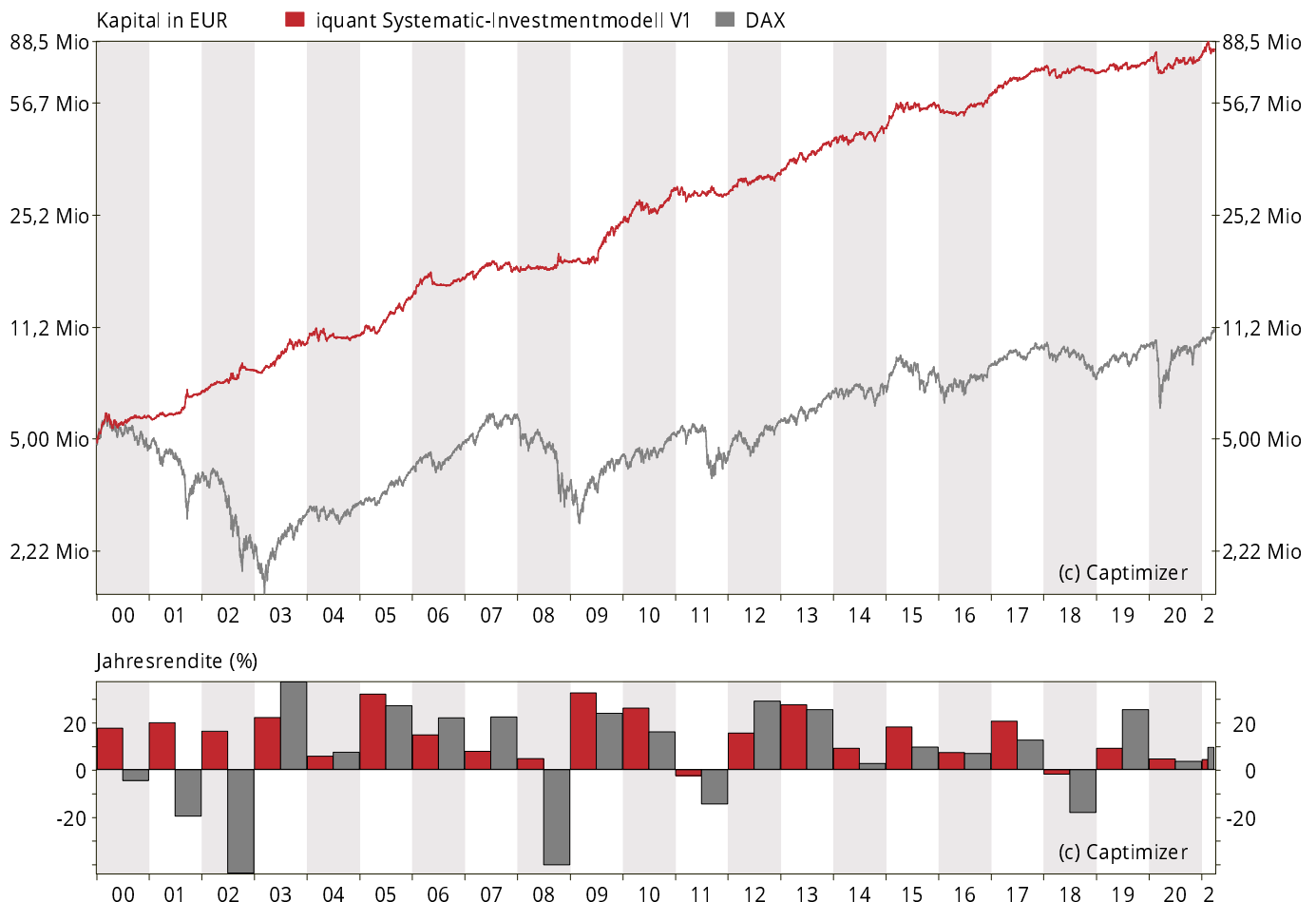


iquant Systematic-Investmentmodell V1

Basisdaten		Beschreibung	
Outperformance	1.455 % (10,36 % p.a.)	1. 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%)	
Transaktionen	2452 (115,4 p.a.)	2. LowRisk (10% LONG - 0% SHORT) - 2Aa LowBeta +Trend 0 10 NASDAQ100-Aktien (10%)	
Benchmark	DAX	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%)	
	Benchmark	Strategie	
Kapital		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%)	
Start 01/2000	5.000.000 EUR	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%)	
Ende 03/2021	11.116.237 EUR	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.	
Rendite			
Rendite p.a. (geo.)	3,83 %	14,19 %	
Rendite 2020	3,55 %	4,50 %	
Rendite 2021 YTD	9,40 %	4,33 %	
Risiko			
Maximaler Rückgang	-72,68 %	-14,52 %	
Mittlerer Rückgang	-21,84 %	-3,11 %	
Volatilität p.a.	20,78 %	9,47 %	
Längste Verlustperiode	7,31 J.	1,49 J.	
Rendite zu Risiko			
Rendite / Max. Rückgang	0,05	0,98	
Rendite / Mittel Rückgang	0,18	4,55	
Rendite / Volatilität p.a.	0,18	1,50	



iquant Systematic-Investmentmodell V1

	Jahresrenditen (%)	Monatsrenditen (%)											
		Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez
2000	17,56	4,27	11,75	-0,23	-2,42	-3,14	1,11	2,01	3,26	1,05	-1,68	1,90	-0,78
2001	19,87	-1,92	2,47	1,38	-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	22,13	-1,23	1,40	2,54	0,93	4,06	2,40	5,38	5,10	-4,73	5,27	-0,51	0,06
2004	5,66	6,64	2,21	-2,75	0,29	-1,88	2,75	-3,06	-0,04	-0,20	-0,36	0,73	1,56
2005	31,95	2,88	2,89	-0,95	-3,47	5,98	3,53	6,50	-0,09	5,81	-2,41	5,86	2,16
2006	14,70	7,48	4,19	2,47	1,22	-4,79	-1,60	0,10	-0,12	1,34	2,01	0,25	1,74
2007	7,75	3,08	-1,89	2,34	3,72	3,09	-0,43	0,86	-3,15	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	32,55	0,59	1,21	-2,81	0,65	1,63	0,26	10,03	4,93	5,59	-2,40	5,86	3,70
2010	26,10	0,52	4,68	6,86	1,74	-2,33	-2,60	-0,69	-0,58	4,97	3,98	3,38	4,01
2011	-2,61	-2,91	1,93	-2,77	1,16	1,01	-0,77	-0,26	1,18	-0,40	-1,93	0,56	0,69
2012	15,51	2,84	3,22	3,91	1,00	-2,24	0,72	3,04	-1,18	1,24	-1,24	2,80	0,61
2013	27,50	3,45	5,61	2,32	-0,11	1,83	-2,16	4,30	-0,87	3,99	3,67	1,76	1,04
2014	9,06	0,03	3,03	-0,87	-2,52	3,95	1,17	-1,86	1,75	0,24	0,07	4,06	-0,11
2015	18,12	7,76	5,52	2,77	-3,22	5,71	-3,10	2,57	-2,67	-0,19	1,89	2,42	-1,95
2016	7,27	-3,46	-0,85	-0,73	-1,11	0,92	0,69	4,19	-0,02	2,16	-0,28	1,98	3,82
2017	20,48	2,12	4,11	2,57	1,11	2,57	-1,38	1,53	2,21	2,25	2,17	-0,16	-0,19
2018	-2,01	1,35	-1,62	-4,74	-0,25	2,93	0,48	1,60	3,11	-0,71	-1,41	-0,17	-2,31
2019	9,06	0,89	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
2021	4,33	2,24	1,26	0,77									
Mittelwert	14,11	1,69	2,16	0,74	0,17	0,83	0,30	1,95	0,80	2,18	0,41	1,42	1,08