

iquant Systematic-Investmentmodell V1

Basisdaten		
Outperformance	1.486 % (10,18 % p.a.)	
Transaktionen	2469 (114,8 p.a.)	
Benchmark	DAX P	
	Benchmark	Strategie
Kapital		
Start 01/2000	5.000.000 EUR	5.000.000 EUR
Ende 06/2021	11.503.179 EUR	85.789.068 EUR
Rendite		
Rendite p.a. (geo.)	3,95 %	14,13 %
Rendite 2020	3,55 %	4,50 %
Rendite 2021 YTD	13,21 %	6,15 %
Risiko		
Maximaler Rückgang	-72,68 %	-14,52 %
Mittlerer Rückgang	-21,59 %	-3,12 %
Volatilität p.a.	20,66 %	9,43 %
Längste Verlustperiode	7,31 J.	1,23 J.
Rendite zu Risiko		
Rendite / Max. Rückgang	0,05	0,97
Rendite / Mittel Rückgang	0,18	4,53
Rendite / Volatilität p.a.	0,19	1,50

Beschreibung

- Dividende (1 5% LONG - 1 0% 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 Dividende Strategie mit 5 Dow-Aktien (5%)
- LowRisk (1 0% 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 (1 0% 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 (1 0% LONG - 1 0% 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.

