

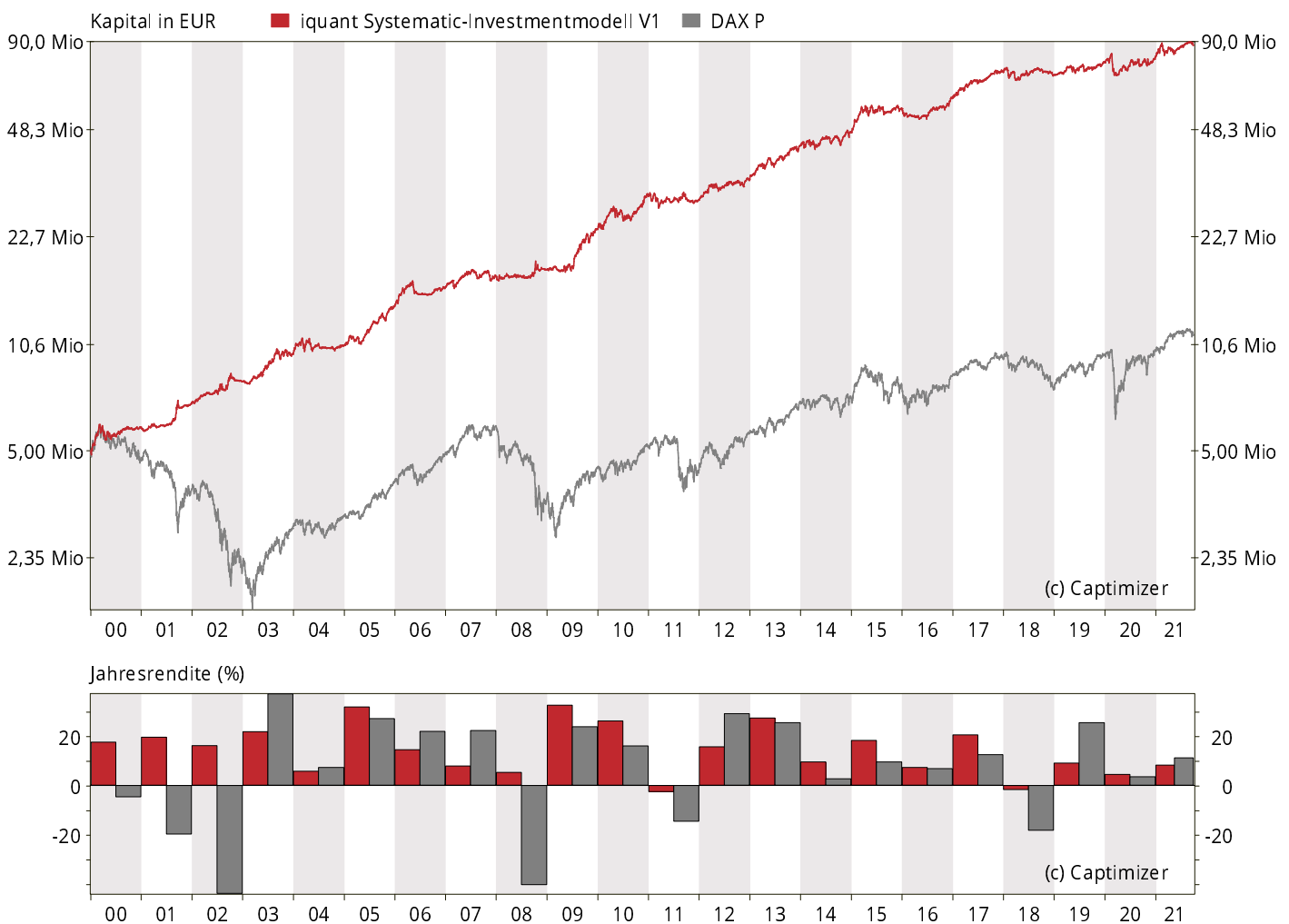
iquant Systematic-Investmentmodell V1

Basisdaten		
Outperformance	1.530 % (10,26 % p.a.)	
Transaktionen	2486 (114,2 p.a.)	
Benchmark	DAX P	
	Benchmark	Strategie
Kapital		
Start 01/2000	5.000.000 EUR	5.000.000 EUR
Ende 09/2021	11.302.942 EUR	87.815.176 EUR
Rendite		
Rendite p.a. (geo.)	3,82 %	14,08 %
Rendite 2020	3,55 %	4,49 %
Rendite 2021 YTD	11,24 %	8,29 %
Risiko		
Maximaler Rückgang	-72,68 %	-14,52 %
Mittlerer Rückgang	-21,35 %	-3,10 %
Volatilität p.a.	20,56 %	9,39 %
Längste Verlustperiode	7,31 J.	1,24 J.
Rendite zu Risiko		
Rendite / Max. Rückgang	0,05	0,97
Rendite / Mittel Rückgang	0,18	4,55
Rendite / Volatilität p.a.	0,19	1,50

Beschreibung

- Dividende (1 5% LONG - 1 0% 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 (1 10% LONG - 0% SHORT)
 - 2Aa LowBeta +Trend 0 10 NASDAQ100-Aktien (10%)
- Relative Stärke (30% LONG - 20% SHORT)
 - 3Aa Momentum MacroTrend 5 HDAX-Aktien (1 0%)
 - 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 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 (1 10% 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.



iquant Systematic-Investmentmodell V1

Jahres- renditen (%)	Monatsrenditen (%)												
	Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	
2000	17,57	4,28	11,74	-0,22	-2,42	-3,14	1,11	2,01	3,26	1,05	-1,68	1,90	-0,79
2001	19,59	-1,92	2,47	1,38	-1,44	1,36	0,21	0,20	4,30	8,19	0,76	0,22	2,68
2002	16,09	1,93	1,51	2,68	0,79	-0,81	0,81	3,71	-1,79	10,67	-2,10	-1,38	-0,38
2003	21,75	-1,22	1,42	2,42	0,86	4,21	2,61	5,45	5,05	-4,75	5,14	-0,81	-0,01
2004	5,82	6,64	2,19	-2,37	0,24	-1,93	2,67	-3,04	-0,01	-0,19	-0,48	0,82	1,50
2005	31,84	2,79	2,74	-0,70	-3,50	6,03	3,50	6,54	-0,15	5,84	-2,44	5,84	2,14
2006	14,53	7,51	4,10	2,53	1,26	-4,79	-1,68	0,10	-0,12	1,32	2,09	0,02	1,80
2007	7,86	2,95	-1,79	2,33	3,68	3,26	-0,27	0,87	-3,21	1,99	2,27	-5,67	1,65
2008	5,24	-0,95	0,55	0,72	-0,34	0,68	-0,49	-0,93	0,23	2,85	2,56	0,68	-0,35
2009	32,57	0,58	1,22	-2,80	0,64	1,63	0,27	10,02	4,92	5,60	-2,41	5,88	3,71
2010	26,15	0,49	4,70	6,86	1,75	-2,29	-2,60	-0,69	-0,58	4,97	3,98	3,37	4,02
2011	-2,60	-2,91	1,93	-2,76	1,16	1,01	-0,76	-0,26	1,18	-0,40	-1,92	0,56	0,69
2012	15,65	2,83	3,23	3,91	1,14	-2,24	0,72	3,03	-1,18	1,24	-1,25	2,79	0,61
2013	27,40	3,45	5,62	2,31	-0,11	1,84	-2,16	4,30	-0,86	3,99	3,67	1,73	0,99
2014	9,55	0,16	3,07	-0,67	-2,49	3,93	1,20	-1,75	1,72	0,32	0,03	4,00	-0,12
2015	18,29	7,76	5,53	2,77	-3,15	5,70	-3,10	2,64	-2,74	-0,15	1,97	2,45	-2,00
2016	7,35	-3,51	-0,88	-0,71	-1,07	0,92	0,69	4,18	-0,02	2,16	-0,18	1,98	3,82
2017	20,46	2,12	4,11	2,57	1,09	2,59	-1,37	1,50	2,22	2,22	2,18	-0,13	-0,20
2018	-1,81	1,42	-1,52	-4,74	-0,23	2,93	0,48	1,60	3,13	-0,71	-1,42	-0,16	-2,33
2019	9,06	0,88	0,04	2,94	2,68	-4,81	2,15	2,07	-0,92	0,71	-0,10	2,02	1,28
2020	4,49	-0,25	-5,81	-2,20	3,29	1,48	2,30	0,12	1,97	-0,53	-2,43	3,11	3,81
2021	8,29	2,24	1,27	1,54	-0,68	0,33	1,98	1,63	1,44	-1,68			
Mittelwert	14,32	1,69	2,16	0,81	0,14	0,81	0,37	1,97	0,81	2,03	0,39	1,39	1,07