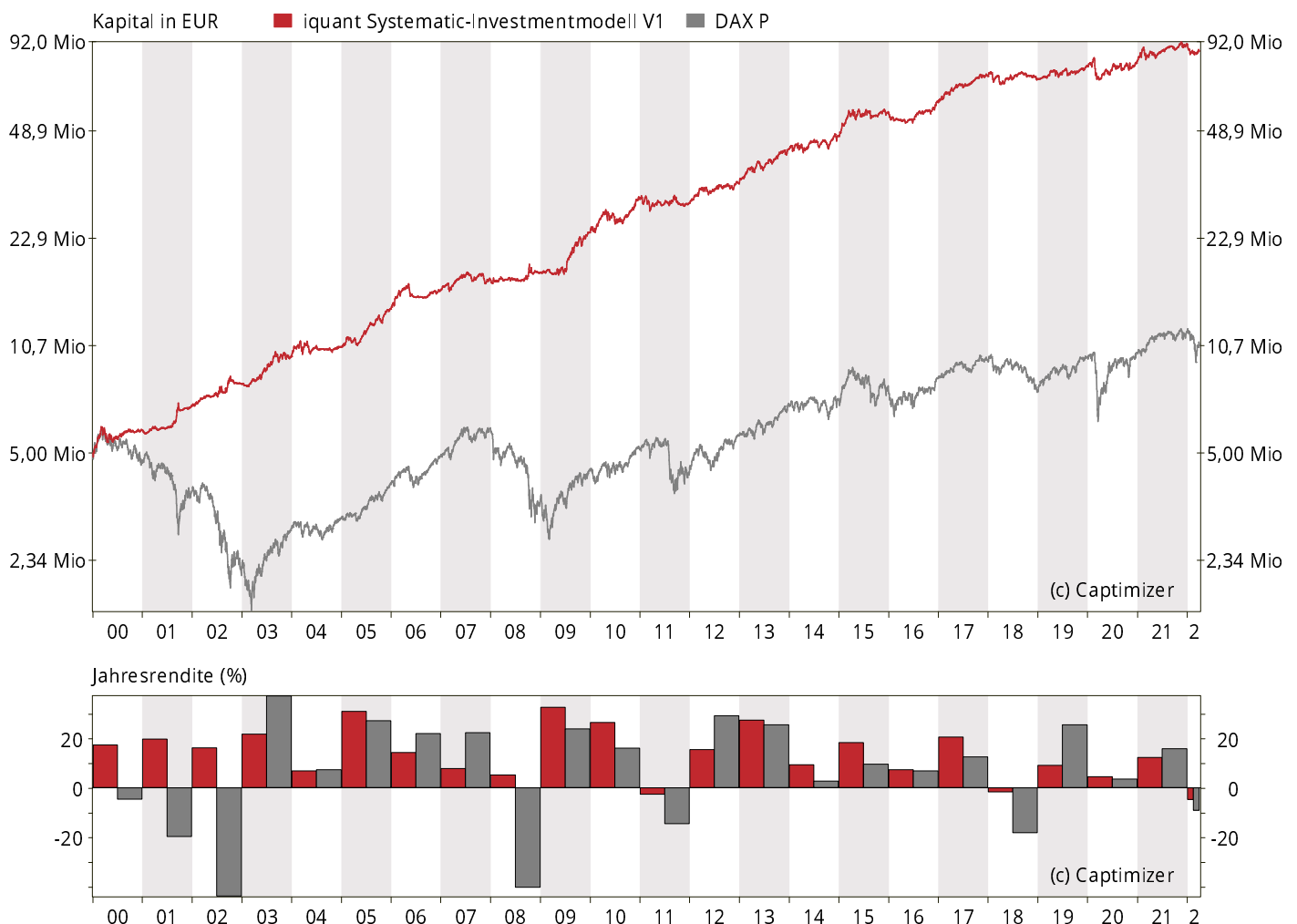


iquant Systematic-Investmentmodell V1

Basisdaten		Beschreibung	
Outperformance	1.509 % (10,18 % p.a.)	1. 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%)	
Transaktionen	2588 (116,3 p.a.)	2. LowRisk (1 0% LONG - 0% SHORT) - 2Aa LowBeta +Trend 0 10 NASDAQ100-Aktien (1 0%)	
Benchmark	DAX P	3. Relative Stärke (30% LONG - 20% SHORT) - 3Aa Momentum MacroTrend 5 HDAX-Aktien (1 0%) - 3Ab MacroTrend HDAX mit ShortDAX-ETF (1 0%) - 3Ba GlobalTrendfilter Momentum 5 HDAX-Aktien (1 0%) - 3Bb GlobalTrendfilter mit ShortDAX-ETF (1 0%) - 3Ca Momentum+Trends NASDAQ100-Aktien (1 0%)	
	Benchmark	Strategie	
Kapital		4. 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%)	
Start 01/2000	5.000.000 EUR	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%)	
Ende 03/2022	10.676.391 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.)	3,47 %	13,64 %	
Rendite 2021	15,79 %	12,31 %	
Rendite 2022 YTD	-9,25 %	-4,81 %	
Risiko			
Maximaler Rückgang	-72,68 %	-14,52 %	
Mittlerer Rückgang	-20,99 %	-3,11 %	
Volatilität p.a.	20,44 %	9,40 %	
Längste Verlustperiode	7,31 J.	1,24 J.	
Rendite zu Risiko			
Rendite / Max. Rückgang	0,05	0,94	
Rendite / Mittel Rückgang	0,17	4,38	
Rendite / Volatilität p.a.	0,17	1,45	



iquant Systematic-Investmentmodell V1

	Jahresrenditen (%)	Monatsrenditen (%)											
		Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez
2000	17,28	4,28	11,74	-0,23	-2,50	-3,30	1,12	1,98	3,26	1,05	-1,65	1,90	-0,78
2001	19,62	-1,92	2,47	1,40	-1,42	1,36	0,21	0,20	4,30	8,19	0,76	0,22	2,68
2002	16,09	1,93	1,51	2,67	0,79	-0,81	0,81	3,71	-1,79	10,67	-2,10	-1,38	-0,38
2003	21,74	-1,22	1,43	2,38	0,86	4,22	2,60	5,45	5,05	-4,75	5,11	-0,76	-0,01
2004	6,89	6,64	2,19	-2,38	0,22	-1,73	2,99	-2,78	0,24	-0,18	-0,48	0,82	1,49
2005	30,87	2,80	2,92	-0,87	-3,50	5,92	3,48	6,45	-0,22	5,54	-2,60	5,79	2,14
2006	14,28	7,49	4,08	2,58	1,05	-4,81	-1,69	0,11	-0,12	1,33	2,08	0,02	1,79
2007	7,76	2,96	-1,80	2,41	3,56	3,19	-0,15	1,01	-3,16	1,98	1,97	-5,69	1,67
2008	5,23	-0,96	0,54	0,72	-0,34	0,68	-0,49	-0,93	0,23	2,85	2,56	0,68	-0,35
2009	32,56	0,58	1,22	-2,80	0,64	1,63	0,27	10,02	4,92	5,60	-2,41	5,87	3,71
2010	26,35	0,49	4,69	6,86	1,75	-2,33	-2,61	-0,69	-0,57	4,94	4,05	3,51	4,06
2011	-2,72	-2,85	2,00	-2,90	1,15	0,97	-0,80	-0,34	1,24	-0,40	-1,92	0,56	0,69
2012	15,49	2,83	3,23	3,91	1,00	-2,23	0,72	3,03	-1,18	1,24	-1,25	2,79	0,62
2013	27,40	3,44	5,62	2,31	-0,11	1,83	-2,16	4,30	-0,86	3,99	3,67	1,73	0,99
2014	9,35	0,16	3,07	-0,67	-2,48	3,90	1,20	-1,87	1,62	0,30	0,10	4,00	-0,11
2015	18,30	7,76	5,53	2,77	-3,15	5,70	-3,11	2,64	-2,75	-0,15	1,97	2,45	-2,00
2016	7,26	-3,51	-0,88	-0,71	-1,07	0,92	0,69	4,18	-0,02	2,16	-0,28	2,00	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	2,93	2,69	-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	12,31	2,24	1,27	1,54	-0,68	0,33	1,98	1,63	1,44	-1,68	1,66	-0,21	2,23
2022	-4,81	-5,68	-0,25	1,18									
Mittelwert	13,63	1,38	2,06	0,81	0,12	0,80	0,39	1,97	0,82	2,02	0,43	1,32	1,13