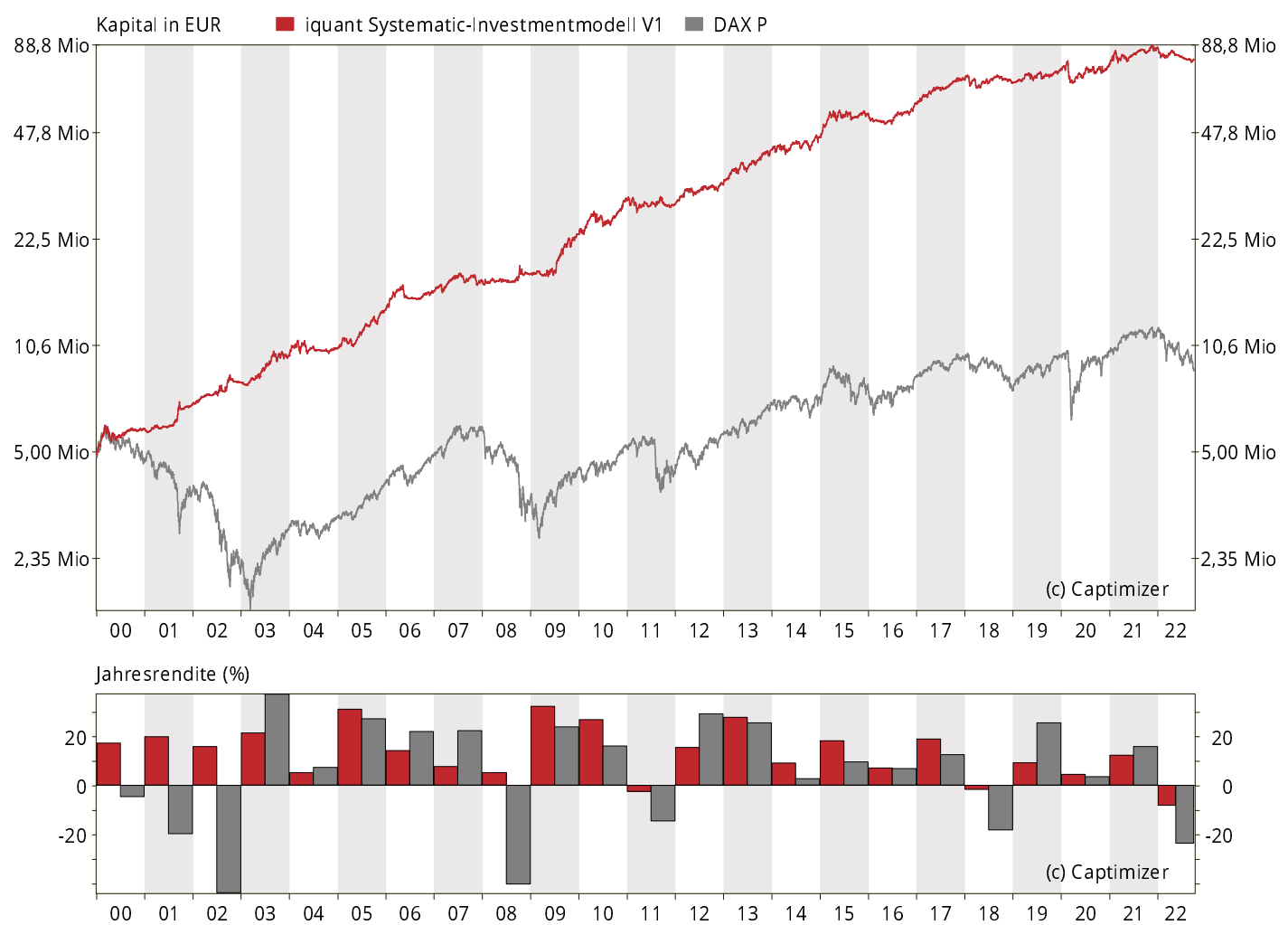


# iquant Systematic-Investmentmodell V1

Basisdaten		Beschreibung	
Outperformance	1.423 % (10,36 % p.a.)	1. 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%)	
Transaktionen	2615 (114,9 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	5.000.000 EUR	
Ende 09/2022	8.972.590 EUR	80.101.847 EUR	
Rendite		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%)	
Rendite p.a. (geo.)	2,60 %	12,96 %	
Rendite 2021	15,79 %	12,28 %	
Rendite 2022 YTD	-23,74 %	-8,23 %	
Risiko		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.	
Maximaler Rückgang	-72,68 %	-14,57 %	
Mittlerer Rückgang	-20,91 %	-3,27 %	
Volatilität p.a.	20,47 %	9,34 %	
Längste Verlustperiode	7,31 J.	1,49 J.	
Rendite zu Risiko			
Rendite / Max. Rückgang	0,04	0,89	
Rendite / Mittel Rückgang	0,12	3,97	
Rendite / Volatilität p.a.	0,13	1,39	



# iquant Systematic-Investmentmodell V1

	Jahresrenditen (%)	Monatsrenditen (%)											
		Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez
2000	17,26	4,27	11,74	-0,23	-2,50	-3,29	1,11	1,98	3,25	1,05	-1,66	1,91	-0,79
2001	19,86	-1,92	2,47	1,40	-1,42	1,36	0,21	0,20	4,31	8,18	0,89	0,24	2,70
2002	15,83	1,89	1,54	2,49	0,72	-0,61	0,67	3,53	-1,77	10,66	-1,95	-1,36	-0,41
2003	21,33	-1,23	1,33	2,49	0,90	3,89	2,40	5,37	5,06	-4,65	5,24	-0,94	0,16
2004	5,22	6,64	2,14	-2,68	0,22	-1,99	2,70	-3,06	-0,03	-0,18	-0,48	0,72	1,48
2005	30,99	3,11	2,89	-0,92	-3,54	5,83	3,51	6,41	-0,20	5,55	-2,65	5,83	2,11
2006	14,18	7,42	4,07	2,58	1,00	-4,83	-1,66	0,10	-0,12	1,31	2,13	-0,01	1,83
2007	7,69	3,04	-1,83	2,35	3,80	3,25	-0,28	0,80	-3,17	2,00	1,97	-5,69	1,67
2008	5,23	-0,96	0,55	0,72	-0,34	0,68	-0,49	-0,93	0,23	2,85	2,56	0,68	-0,35
2009	32,13	0,58	1,22	-2,80	0,64	1,62	0,27	10,03	4,89	5,59	-2,30	5,48	3,67
2010	26,81	0,48	4,80	6,92	1,68	-2,60	-2,90	-0,40	-0,26	5,40	4,00	3,38	4,04
2011	-2,61	-2,93	1,93	-2,77	1,16	1,01	-0,76	-0,25	1,19	-0,43	-1,89	0,56	0,69
2012	15,39	2,84	3,23	3,92	1,00	-2,25	0,72	3,04	-1,18	1,24	-1,25	2,69	0,62
2013	27,70	3,45	5,62	2,31	-0,11	1,83	-2,17	4,30	-0,86	3,99	3,67	1,94	1,01
2014	9,04	-0,03	3,04	-0,87	-2,51	3,96	1,18	-1,86	1,74	0,24	0,09	4,06	-0,11
2015	18,15	7,76	5,56	2,74	-3,15	5,73	-3,13	2,20	-2,54	0,05	1,80	2,32	-1,80
2016	7,03	-3,42	-0,80	-0,80	-1,19	1,01	0,74	4,20	0,20	1,71	0,04	1,70	3,67
2017	18,81	2,00	3,48	2,57	1,10	2,20	-1,33	1,31	2,32	1,91	2,21	-0,04	-0,27
2018	-1,76	1,33	-1,66	-4,66	-0,20	2,96	0,25	1,70	3,46	-0,73	-1,39	-0,39	-2,17
2019	9,24	0,97	0,03	2,93	2,74	-4,83	2,17	2,11	-0,90	0,72	-0,13	2,07	1,25
2020	4,41	-0,27	-5,87	-2,20	3,29	1,48	2,30	0,13	1,97	-0,52	-2,43	3,11	3,80
2021	12,28	2,24	1,27	1,54	-0,68	0,32	1,98	1,63	1,44	-1,68	1,66	-0,21	2,21
2022	-8,23	-5,68	-0,26	1,20	1,19	-1,72	-0,97	-1,77	-0,16	-0,20			
Mittelwert	13,30	1,37	2,02	0,79	0,17	0,65	0,28	1,77	0,82	1,92	0,46	1,27	1,14