Backtestergebnisse der Scoring-Modelle

Ausführung: weltweite Analysen

nur zur privaten Nutzung

Weitergabe und Weiterverbreitung nur mit ausdrücklicher Zustimmung seitens investolio

Stand: 23.03.2022

Einführung: Erklärung der Analysemethoden

Auf den folgenden Seiten erhalten Sie eine kurze Erklärung wie unsere Backtests aufgebaut sind und was die einzelnen Analysen aussagen. Natürlich können Sie aber auch ohne diese Einführung zu lesen direkt zu den ausführlichen Backtestergebnissen springen. Nutzen Sie diese Erklärungen auch gerne als Nachschlagwerk, wenn bei der Betrachtung der Ergebnisse Fragen aufkommen. Die Erklärungen hier sind bewusst etwas knapper gehalten. Eine ausführliche Erläuterung über unsere Vorgehensweise beim Backtesting sowie die Auswertung der Ergebnisse erhalten Sie in unseren Videokursen. Die Videokurse sind Teil des investolio-Premium-Bereichs.

Folgende Videokurse sind hierfür von besonderer Relevanz:

- Videokurs „Backtests“ (als Einführung in das Thema Backtesting)
- Videokurs „Backtestmethodik“ (insb. das Video „Drei Ergebnisse der Backtests“)
- Videokurs „Anwendung der Scoring-Modelle“ (die beiden Videos „Ein beispielhaftes Backtestergebnis“)

Dezilanalyse

Die Dezilanalyse basiert auf dem mathematischen Konstrukt der Quantile. Dezile sind dabei eine bestimmte Form der Quantile, bei denen in unserem Kontext das Anlageuniversum in 10 gleich große Teile eingeteilt wird. Die Einteilung in die Dezile erfolgt auf Basis des jeweils analysierte Scoring-Modells. Die Dezileinteilung auf Basis der Scores sieht dann bspw. so aus:

Dezil	Score
Dezil 1	100% - 90%
Dezil 2	89,9% - 80%
Dezil 3	79,9% - 70%
Dezil 4	69,9% - 60%
Dezil 5	59,9% - 50%
Dezil 6	49,9% - 40%
Dezil 7	39,9% - 30%
Dezil 8	29,9% - 20%
Dezil 9	19,9% - 10%
Dezil 10	9,9% - 0%

Damit befinden sich die besten 10% der Aktien des analysierten Scoring-Modells in Dezil 1, während sich die schlechtesten 10% in Dezil 10 befinden. Bei unserer Dezilanalyse passen wir die Dezile einmal im Quartal an. Das bedeutet einmal im Quartal wird geguckt welche Aktien zu welchem Dezil gehören und entsprechend werden die Dezile neu eingeteilt. Sie können sich also jedes Dezil wie ein Depot vorstellen, das zu Beginn eines Quartals alle Aktien mit einem Score zwischen X% und Y% beinhaltet.

Abweichend zur Depotanalyse (nächster Abschnitt) berechnen wir also nicht nur die Renditen eines einzelnen Depots, sondern die Renditen für jedes der 10 Dezile. In der Dezilanalyse sind jederzeit alle investierbaren Aktien enthalten und wir erhalten einen besseren Eindruck davon, ob eine Kennzahl dazu in der Lage ist gute von schlechten Aktien zu unterscheiden.

Das perfekte Ergebnis dieser Dezilanalyse würde so aussehen, dass die Rendite in Dezil 1 am höchsten ist, die zweithöchste Rendite findet sich bei Dezil 2, die dritthöchste bei Dezil 3 usw. Die schlechteste Rendite würde Dezil 10 aufweisen. Im Idealfall sind ähnliche Betrachtungen für die Risikomaße festzustellen, nur dass hier die geringste Volatilität und der geringste Maximale Drawdown in den vorderen Dezilen (also 1, 2, usw.) auftauchen sollten, während die Risikomaße in den hinteren Dezilen (also 10, 9, usw.) immer größer werden. Ist eine derartige Struktur zu erkennen, ist das untersuchte Scoring-Modell sehr gut in der Lage gute von schlechten Aktien zu unterscheiden.

Depotanalyse

Bei der Depotanalyse analysieren wir eine Investmentstrategie in der Form, als hätten wir sie wie ein Depot umgesetzt. Die Investmentstrategie ergibt sich auf Basis des analysierten Scoring-Modells. Hierfür werden zu Beginn die X Aktien mit dem höchsten Score gekauft. Eine Aktie wird verkauft, wenn das analysierte Scoring-Modell für die entsprechende Aktie eine vorab definierte Grenze unterschritten hat. Wie viele Aktien in ein Depot aufgenommen werden und bei Unterschreitung welcher Score-Grenze verkauft wird ist in den Strategiespezifikationen des jeweiligen Backtestergebnisses angegeben.

In den Ergebnissen der Depotanalyse sehen Sie jeweils 3 Spalten (Depot, Depot IQ und Benchmark). Der Spalte Depot sind die Performancemaße für die analysierte Investmentstrategie zu entnehmen. Die Spalte Depot IQ zeigt die Ergebnisse der analysierten Investmentstrategie unter Berücksichtigung unserer variablen Investitionsquote an. Abhängig von der aktuellen Marktlage ist hier eine Cashposition von bis zu 50% möglich. In der Spalte Benchmark sind abschließend die Performancemaße für den verwendeten Vergleichsindex aufgelistet.

Mit der Analyse eines Depots können wir zwar besonders gut simulieren, wie sich eine real umsetzbare Investmentstrategie in der Vergangenheit entwickelt hätte, wir beschränken uns in der Analyse aber auf einige wenige Aktien aus dem gesamten Anlageuniversum. Ergänzend zur Depotanalyse führen wir daher die im vorherigen Abschnitt vorgestellte Dezilanalyse durch, mit der wir jederzeit das komplette Anlageuniversum analysieren können.

Vergleich einzelner Jahre

In einer dritten Analyse wollen wir untersuchen, wie sich eine Investmentstrategie über die einzelnen Jahre entwickelt hätte. Bislang haben wir immer nur Analysen für den gesamten Zeitraum betrachtet. Was ist nun aber, wenn eine über 20 Jahre betrachtete Strategie in den ersten 10 Jahren besonders toll performt hat und die letzten 10 Jahre überhaupt nicht mehr überzeugen konnte? Das wäre alles andere als ein Zeichen von Stabilität und Zuverlässigkeit.

Für die Analyse einzelner Jahre reicht die Betrachtung der jährlichen Renditen aus. Alle anderen Rendite- und Risikomaße konnten wir bereits in unserer Depotanalyse bzw. Dezilanalyse ermitteln. Mit der Analyse einzelner Jahre wollen wir nur noch sicherstellen, dass die erzielten Renditen gleichmäßig über den gesamten Betrachtungszeitraum erzielt wurden und nicht nur einzelne Jahre Treiber der Performance sind.

Für diese Analyse betrachten wir also die jährlichen Renditen unserer Investmentstrategie. Die absoluten Renditen sagen uns dabei allerdings wenig aus. Wir müssen sie immer in Relation zu der vom Vergleichsindex erzielten Rendite sehen (für Deutschland betrachten wir hier bspw. den CDAX).

Wir betrachten für jedes einzelne Jahr drei Renditekennzahlen:

- 1. & 2. Dezil vs. Vergleichsindex: Das erste und zweite Dezil enthalten die vermeintlich besten Aktien. Die durchschnittlichen Renditen aus diesen beiden Dezilen sollten im Vergleich zur Rendite des Vergleichsindex nach Möglichkeit in jedem Jahr höher sein. Hohe Werte sind hier entsprechend grün und niedrige rot eingefärbt.
- 9. & 10. Dezil vs. Vergleichsindex: Das neunte und zehnte Dezil enthalten die vermeintlich schlechtesten Aktien. Die durchschnittlichen Renditen aus diesen beiden Dezilen sollten im Vergleich zur Rendite des Vergleichsindex nach Möglichkeit in jedem Jahr niedriger sein. Hohe Werte werden hier rot und niedrige Werte grün hervorgehoben werden.
- Depot vs. Vergleichsindex: Mit dieser Rendite vergleichen wir die Rendite unseres konstruierten Depots aus der Depotanalyse mit der Rendite des Vergleichsindex. Die Rendite unseres Depots sollte im Vergleich zur Rendite des Vergleichsindex nach Möglichkeit in jedem Jahr höher sein. Hohe Werte sind entsprechend grün und niedrige rot eingefärbt.

5-Jahres-Analysen

Um auch einen Eindruck über die Performance der Investmentstrategie bzw. des analysierten Scoring-Modells in einzelnen „Sub-Perioden“ zu erhalten werden einzelne 5-Jahres-Zeiträume betrachtet. Ergänzend zu der Analyse der jährlichen Renditen lässt sich so feststellen, ob die Investmentstrategie bzw. das Scoring-Modell auch über unterschiedliche Zeiträume eine gute Performance verzeichnen konnte. Die in der Dezilanalyse und Depotanalyse durchgeführten Auswertungen werden hier für jeden 5-Jahres-Zeitraum für die annualisierte Rendite, die Volatilität sowie den Maximalen Drawdown ermittelt.

Was sagen die Kennzahlen aus?

Strategiespezifikationen

Die Strategiespezifikationen geben Auskunft über Beginn und Ende der Analyse, die untersuchte Region, die verwendete Benchmark sowie natürlich das analysierte Scoring-Modell. Außerdem gibt der Wert unter „Durchschnittliche Anzahl Aktien“ an, wie viele Aktien über den gesamten Analysezeitraum ausreichend Daten vorweisen konnten. Für einen aussagekräftigen Backtest sollte dieser Wert größer sein als 100 Aktien. Die meisten Analysen beginnen Anfang 2002 und gehen bis Ende 2021. Einige Regionen weichen aufgrund der Datenverfügbarkeit hiervon allerdings ab. Das Startdatum der Analyse für jede Regionen können Sie den Strategiespezifikationen entnehmen.

Bei der Depotanalyse werden noch zusätzliche Daten angegeben. Das betrifft die Anzahl der im Depot enthaltenen Aktien, das Verkaufskriterium (bei Unterschreitung welcher Score-Grenze wird eine Aktie verkauft) sowie den Depotumschlagsfaktor. Der Depotumschlagsfaktor ist ein Maß dafür wie häufig einzelne Aktien gekauft und verkauft werden. Ein Depotumschlagsfaktor von 2 sagt bspw. aus, dass eine einzelne Position im Depot im Jahr 2 Mal wechselt. Andersherum lässt sich sagen, dass die durchschnittliche Haltedauer einer Aktie 6 Monate beträgt (= 12 Monate / 2).

Wichtigste Performancemaße

Zu den wichtigsten Performancemaßen gehören die annualisierte Rendite, die Volatilität, der Maximale Drawdown sowie das Rendite-Risiko-Verhältnis. Das Rendite-Risiko-Verhältnis ergibt sich indem die Rendite durch die Volatilität dividiert wird. Um eine Investmentstrategie oder ein Scoring-Modell zu beurteilen betrachten wir in erster Linie diese vier Kennzahlen.

Für die Rendite sowie das Rendite-Risiko-Verhältnis gilt, dass hohe Werte besser sind als niedrige. In der Dezilanalyse sind hohe Werte somit grün und niedrige Werte rot hervorgehoben. Bei der Volatilität und dem Maximalen Drawdown werden hingegen niedrige Werte bevorzugt. Hier sind hohe Werte entsprechend rot und niedrige Werte grün eingefärbt.

Weitere Performancemaße

Um einen noch besseren Eindruck über die Performance einer Investmentstrategie bzw. eines Scoring-Modells zu erhalten betrachten wir zusätzlich noch ein paar weitere Performancemaße. Hierbei handelt es sich um folgende Kennzahlen:

- Max 3 Jahre rollierend: Gibt die Rendite über den besten 3-Jahres-Zeitraum an (Best-Case-Betrachtung)
- Min 3 Jahre rollierend: Gibt die Rendite über den schlechtesten 3-Jahres-Zeitraum an (Worst-Case-Betrachtung)
- Max 5 Jahre rollierend: Gibt die Rendite über den besten 5-Jahres-Zeitraum an (Best-Case-Betrachtung)
- Min 5 Jahre rollierend: Gibt die Rendite über den schlechtesten 5-Jahres-Zeitraum an (Worst-Case-Betrachtung)
- Anteil Outperformance 1 Jahr: Gibt an über wie viele rollierende 52-Wochen-Zeiträume die Investmentstrategie bzw. das jeweilige Dezil besser performt hat als der Vergleichsindex

Deutschland – CDAX

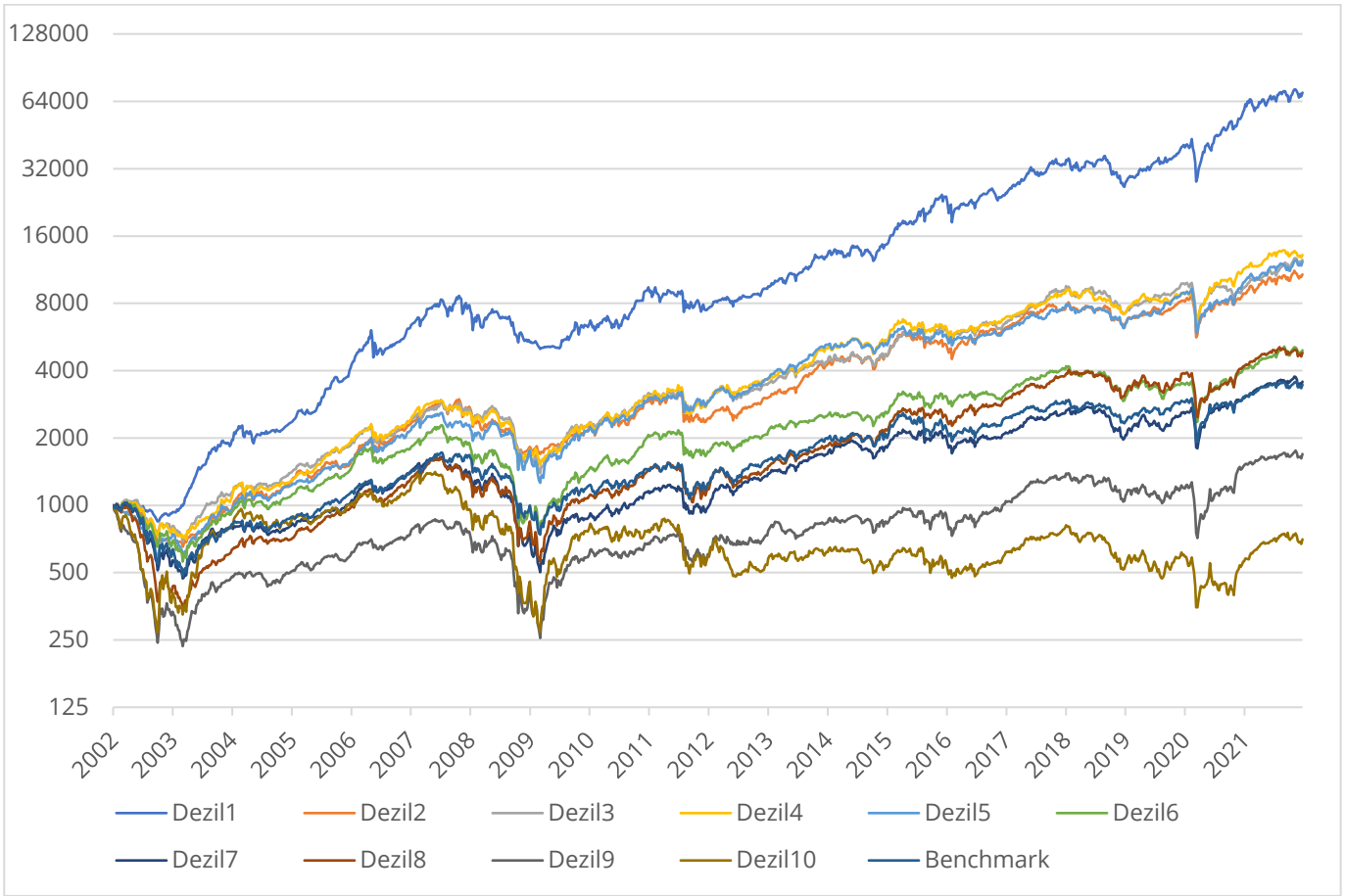
Trend-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Deutschland
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	CDAX
Durchschnittliche Anzahl Aktien	166	Scoring-Modell:	Trend-Score

Dezilanalyse

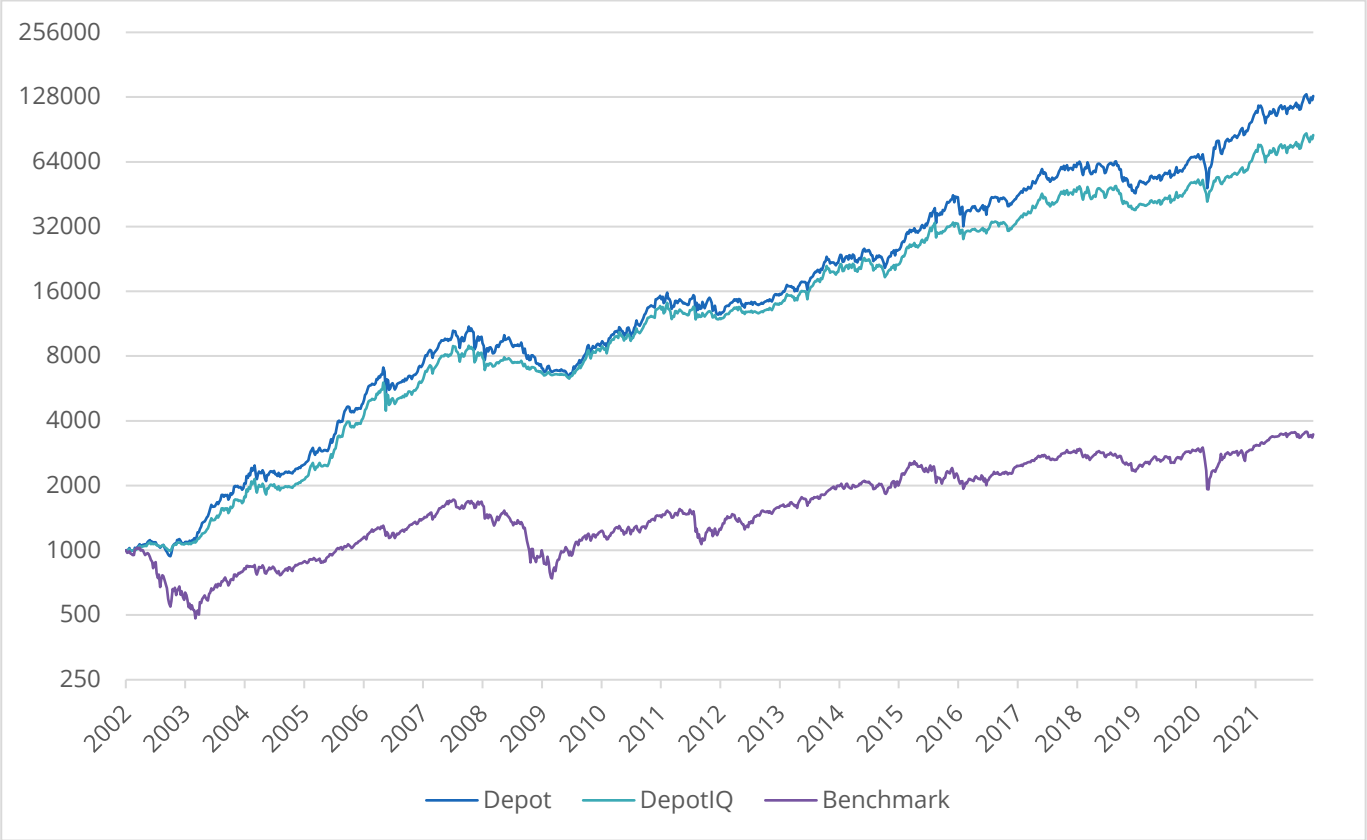
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	6,4%	23,6%	12,6%	13,4%	13,7%	13,3%	8,3%	6,6%	8,2%	2,7%	-1,7%
Annualisierte Volatilität	22,2%	23,0%	19,9%	19,2%	19,3%	19,8%	20,9%	21,5%	23,1%	26,3%	31,6%
Maximaler Drawdown	57,0%	42,2%	44,7%	51,8%	50,3%	51,3%	66,0%	69,5%	66,0%	76,6%	80,7%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,288	1,027	0,633	0,699	0,711	0,674	0,396	0,305	0,353	0,101	-0,055
Max 3 Jahre rollierend	152,7%	400,8%	175,9%	208,3%	204,2%	201,8%	201,6%	153,4%	222,7%	183,3%	259,3%
Min 3 Jahre rollierend	-40,2%	-25,7%	-23,5%	-33,4%	-29,4%	-29,3%	-54,6%	-58,4%	-49,3%	-61,8%	-75,5%
Max 5 Jahre rollierend	205,5%	869,0%	325,6%	266,8%	277,9%	308,3%	222,9%	263,5%	303,2%	234,9%	333,6%
Min 5 Jahre rollierend	-24,4%	-0,1%	-14,0%	4,9%	-1,7%	-3,5%	-24,6%	-35,8%	-24,9%	-47,2%	-69,7%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	87,9%	75,8%	72,6%	82,7%	77,4%	56,9%	58,5%	68,2%	42,7%	26,6%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	27,4%	24,8%	6,4%
Annualisierte Volatilität	25,5%	21,4%	22,2%
Maximaler Drawdown	41,2%	29,8%	57,0%
Rendite-Risiko-Verhältnis	1,077	1,159	0,288
Max 3 Jahre rollierend	435,0%	393,4%	152,7%
Min 3 Jahre rollierend	-6,2%	6,0%	-40,2%
Max 5 Jahre rollierend	996,5%	758,3%	205,5%
Min 5 Jahre rollierend	31,0%	44,7%	-24,4%
Anteil Outperformance 1 Jahr	85,5%	84,3%	---

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Trend	70%
Verkaufskriterium 2	Trend	70%
Depotumschlagsfaktor	1,59	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	48,3%	20,9%	-24,5%
30.12.2002	bis	29.12.2003	44,3%	34,0%	45,8%
29.12.2003	bis	27.12.2004	19,2%	20,8%	-3,3%
27.12.2004	bis	26.12.2005	63,2%	18,0%	-10,0%
26.12.2005	bis	25.12.2006	27,1%	29,2%	-2,4%
25.12.2006	bis	31.12.2007	16,4%	2,4%	-28,6%
31.12.2007	bis	29.12.2008	18,3%	11,2%	-8,6%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-7,4%	-11,9%	36,2%
28.12.2009	bis	27.12.2010	49,3%	22,0%	-11,4%
27.12.2010	bis	26.12.2011	-0,9%	-2,0%	-3,6%
26.12.2011	bis	31.12.2012	-7,3%	-5,1%	-19,2%
31.12.2012	bis	30.12.2013	15,4%	12,9%	-12,5%
30.12.2013	bis	29.12.2014	9,7%	8,1%	-9,9%
29.12.2014	bis	28.12.2015	67,9%	28,8%	-2,1%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-9,0%	2,1%	0,3%
26.12.2016	bis	25.12.2017	25,1%	12,2%	14,0%
25.12.2017	bis	31.12.2018	-6,5%	1,2%	-8,8%
31.12.2018	bis	30.12.2019	23,2%	16,3%	-9,9%
30.12.2019	bis	28.12.2020	50,5%	19,1%	3,6%
28.12.2020	bis	27.12.2021	9,2%	8,4%	6,4%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	-4,4%	32,9%	7,9%	11,8%	8,4%	6,9%	2,9%	-7,0%	-11,2%	-20,8%	-5,9%
27.12.2004	bis	28.12.2009	6,8%	21,7%	11,4%	10,1%	12,3%	11,9%	5,5%	1,7%	8,9%	3,2%	-1,8%
28.12.2009	bis	29.12.2014	11,3%	18,5%	16,8%	15,9%	19,1%	19,9%	12,9%	15,9%	15,2%	7,6%	-6,6%
29.12.2014	bis	30.12.2019	6,8%	22,7%	11,9%	15,6%	10,2%	10,9%	6,0%	7,2%	12,2%	7,2%	2,1%
30.12.2019	bis	27.12.2021	9,2%	31,0%	14,4%	12,8%	21,5%	17,2%	18,6%	17,1%	11,0%	18,9%	8,1%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	28,7%	17,3%	18,4%	16,9%	19,6%	21,0%	21,5%	22,7%	27,2%	33,1%	43,1%
27.12.2004	bis	28.12.2009	23,5%	26,1%	20,4%	22,3%	21,6%	23,4%	27,1%	26,6%	28,3%	31,1%	36,5%
28.12.2009	bis	29.12.2014	19,5%	21,7%	21,6%	17,8%	19,5%	16,8%	16,5%	16,9%	18,6%	20,0%	25,1%
29.12.2014	bis	30.12.2019	17,4%	21,7%	15,8%	16,0%	15,5%	15,3%	15,3%	17,1%	17,0%	19,5%	22,0%
30.12.2019	bis	27.12.2021	25,1%	28,4%	25,3%	24,4%	21,1%	24,7%	24,7%	25,4%	25,3%	30,7%	33,8%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	53,1%	18,7%	36,2%	35,3%	31,7%	42,9%	45,7%	53,5%	66,0%	76,6%	73,0%
27.12.2004	bis	28.12.2009	57,0%	42,2%	44,7%	51,8%	50,3%	51,3%	66,0%	69,5%	65,5%	70,6%	80,7%
28.12.2009	bis	29.12.2014	31,2%	22,6%	25,7%	19,4%	25,8%	18,9%	24,7%	25,8%	33,3%	27,5%	44,9%
29.12.2014	bis	30.12.2019	25,5%	27,3%	24,4%	25,0%	22,4%	22,1%	30,1%	28,5%	25,3%	26,5%	42,2%
30.12.2019	bis	27.12.2021	36,2%	35,7%	35,1%	37,3%	29,8%	36,8%	34,2%	34,3%	37,2%	43,6%	41,9%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	35,6%	28,5%	-4,4%	19,0%	17,0%	28,7%	15,9%	15,3%	53,1%
27.12.2004	bis	28.12.2009	29,0%	31,8%	6,8%	28,0%	24,3%	23,5%	41,2%	29,8%	57,0%
28.12.2009	bis	29.12.2014	22,6%	20,1%	11,3%	23,9%	20,3%	19,5%	20,9%	18,6%	31,2%
29.12.2014	bis	30.12.2019	22,2%	19,4%	6,8%	25,5%	20,8%	17,4%	28,9%	22,8%	25,5%
30.12.2019	bis	27.12.2021	38,1%	28,4%	9,2%	31,2%	24,1%	25,1%	30,6%	21,0%	36,2%

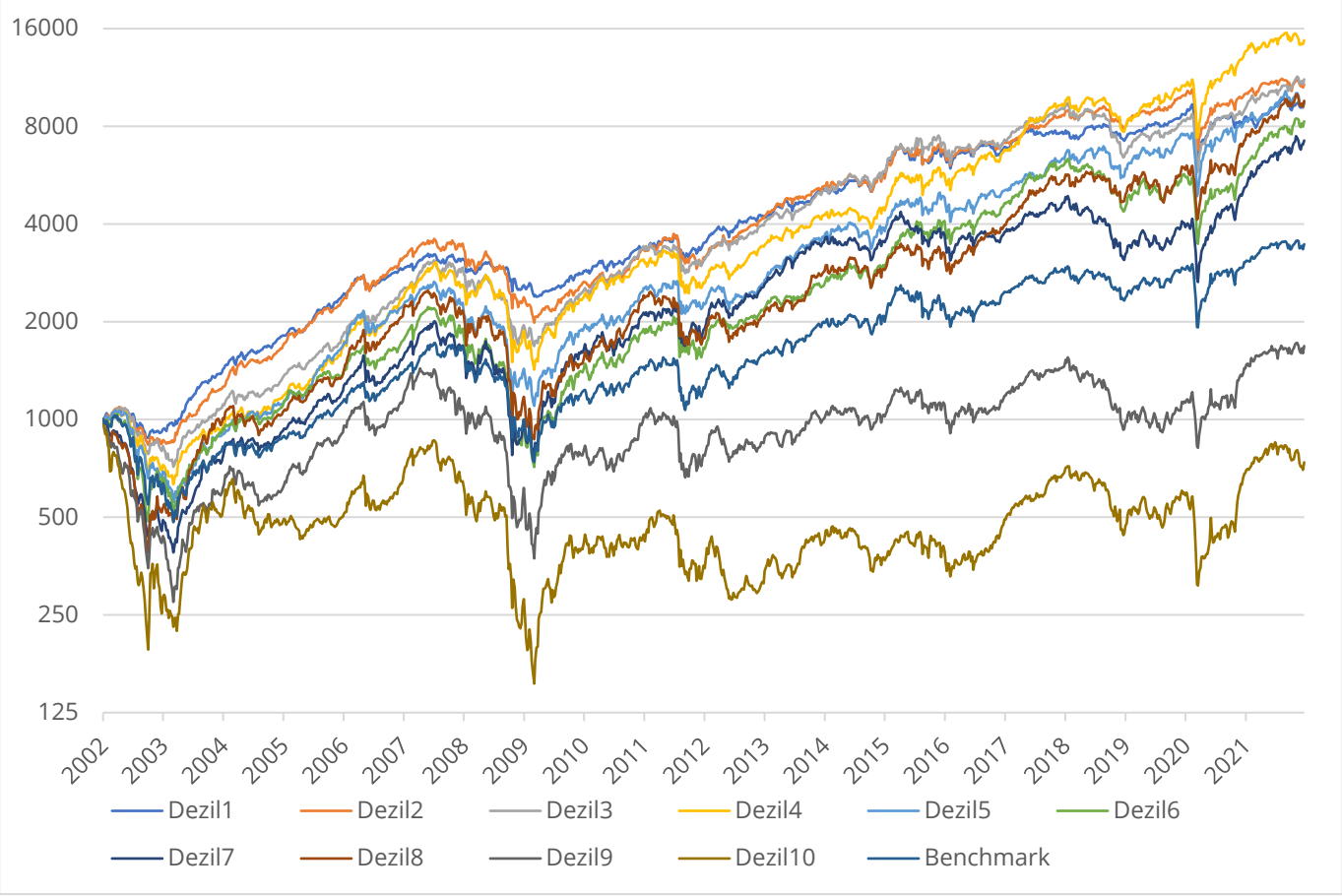
Safety-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Deutschland
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	CDAX
Durchschnittliche Anzahl Aktien	166	Scoring-Modell:	Safety-Score

Dezilanalyse

	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	6,4%	11,9%	12,6%	12,8%	14,4%	11,9%	11,1%	10,4%	11,9%	2,6%	-1,5%
Annualisierte Volatilität	22,2%	13,4%	15,2%	17,3%	19,2%	21,1%	23,7%	23,7%	25,2%	27,6%	34,4%
Maximaler Drawdown	57,0%	32,4%	44,9%	45,6%	53,3%	58,6%	67,9%	61,9%	65,2%	74,0%	84,7%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,288	0,889	0,827	0,740	0,750	0,563	0,471	0,439	0,473	0,095	-0,044
Max 3 Jahre rollierend	152,7%	179,4%	205,2%	179,5%	199,8%	259,6%	213,8%	249,6%	246,2%	282,4%	173,8%
Min 3 Jahre rollierend	-40,2%	-13,8%	-25,5%	-26,7%	-24,7%	-44,2%	-54,9%	-44,7%	-47,2%	-65,3%	-74,1%
Max 5 Jahre rollierend	205,5%	259,4%	320,1%	283,2%	303,1%	277,3%	311,2%	360,0%	474,5%	267,9%	286,8%
Min 5 Jahre rollierend	-24,4%	-7,5%	-3,2%	-15,7%	-5,8%	-13,6%	-25,5%	-36,0%	-29,1%	-45,9%	-74,4%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	58,1%	71,0%	75,0%	83,9%	75,8%	65,3%	62,5%	65,7%	41,9%	39,9%

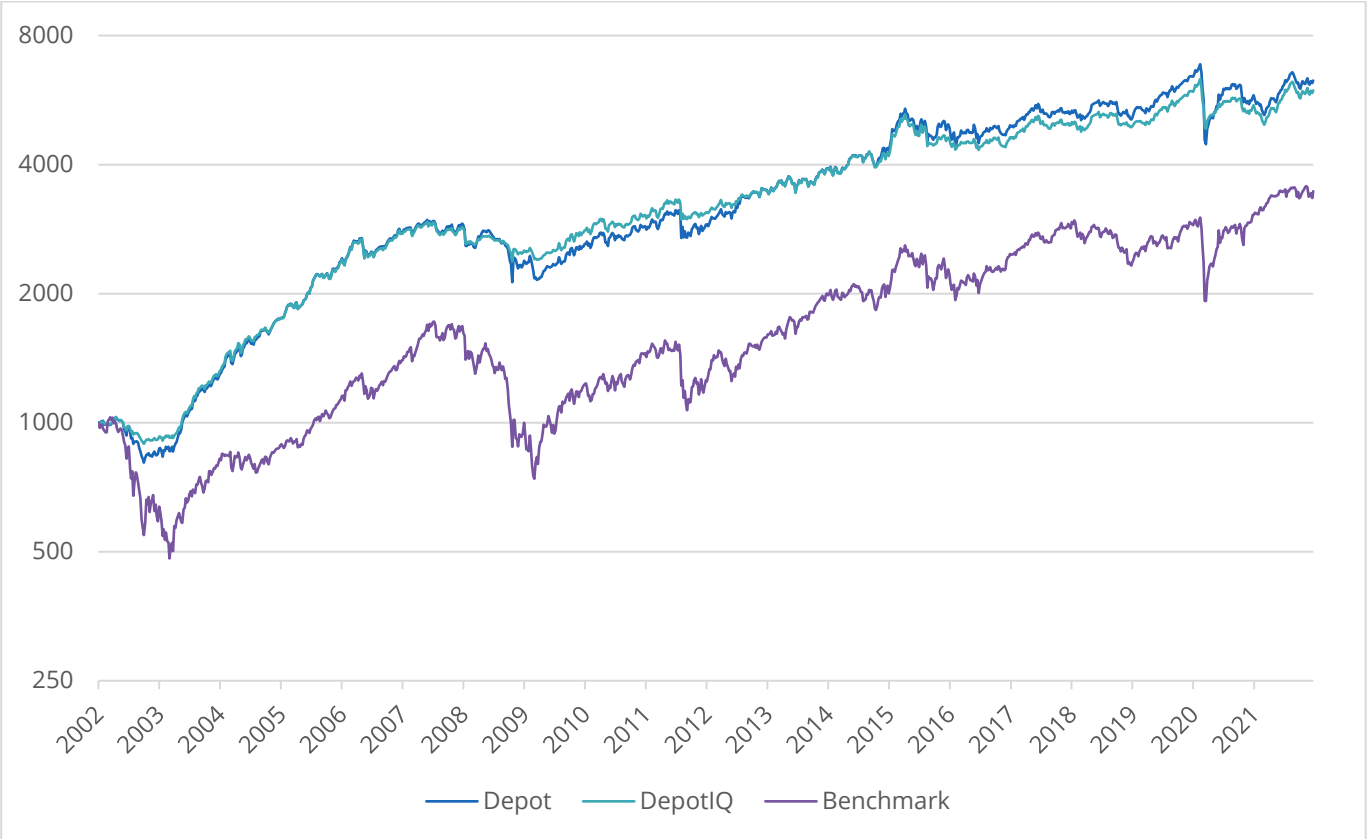


Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	9,6%	9,3%	6,4%
Annualisierte Volatilität	13,9%	10,8%	22,2%
Maximaler Drawdown	35,0%	23,4%	57,0%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,690	0,861	0,288

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Safety	80%
Verkaufskriterium 2	Safety	80%
Depotumschlagsfaktor	0,88	

Max 3 Jahre rollierend	209,3%	185,9%	152,7%
Min 3 Jahre rollierend	-18,7%	-9,6%	-40,2%
Max 5 Jahre rollierend	255,7%	216,2%	205,5%
Min 5 Jahre rollierend	-15,3%	-5,2%	-24,4%
Anteil Outperformance 1 Jahr	53,6%	49,2%	---



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	25,8%	29,0%	-25,4%
30.12.2002	bis	29.12.2003	13,2%	13,1%	34,1%
29.12.2003	bis	27.12.2004	28,4%	22,8%	-10,1%
27.12.2004	bis	26.12.2005	7,2%	7,4%	-1,8%
26.12.2005	bis	25.12.2006	-4,7%	5,0%	3,2%
25.12.2006	bis	31.12.2007	-17,6%	-11,9%	-22,3%
31.12.2007	bis	29.12.2008	23,8%	18,3%	-9,8%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-18,2%	-17,5%	14,6%
28.12.2009	bis	27.12.2010	-7,1%	4,9%	-1,0%
27.12.2010	bis	26.12.2011	15,1%	12,7%	-6,4%
26.12.2011	bis	31.12.2012	-7,3%	-0,5%	-28,1%
31.12.2012	bis	30.12.2013	-14,4%	-3,4%	-0,6%
30.12.2013	bis	29.12.2014	7,2%	5,6%	-7,7%
29.12.2014	bis	28.12.2015	4,3%	8,9%	-0,3%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-9,1%	-3,4%	2,0%
26.12.2016	bis	25.12.2017	-9,4%	-0,8%	17,0%
25.12.2017	bis	31.12.2018	15,8%	11,7%	-16,1%
31.12.2018	bis	30.12.2019	1,1%	-1,2%	2,7%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-15,7%	-6,2%	15,5%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-4,0%	-3,5%	-0,8%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	-4,4%	21,9%	18,4%	10,0%	5,2%	3,7%	2,9%	-2,9%	1,1%	-15,5%	-22,1%
27.12.2004	bis	28.12.2009	6,8%	9,2%	9,7%	13,1%	15,1%	10,9%	5,1%	11,8%	7,5%	5,0%	-3,5%
28.12.2009	bis	29.12.2014	11,3%	15,3%	16,4%	18,7%	13,8%	15,7%	16,4%	17,1%	14,3%	5,9%	-1,1%
29.12.2014	bis	30.12.2019	6,8%	8,6%	12,1%	7,5%	18,8%	14,1%	13,7%	2,6%	15,5%	1,9%	9,6%
30.12.2019	bis	27.12.2021	9,2%	4,6%	3,8%	15,5%	17,3%	11,8%	20,6%	34,0%	26,6%	21,7%	11,3%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	28,7%	11,3%	12,6%	15,0%	18,7%	20,8%	26,2%	24,1%	29,1%	33,1%	48,5%
27.12.2004	bis	28.12.2009	23,5%	12,1%	16,4%	19,3%	22,2%	25,0%	27,9%	29,8%	30,6%	33,4%	38,3%
28.12.2009	bis	29.12.2014	19,5%	13,4%	13,9%	15,9%	17,2%	18,7%	21,1%	20,0%	21,9%	23,4%	28,2%
29.12.2014	bis	30.12.2019	17,4%	12,4%	13,2%	15,7%	16,3%	16,9%	18,5%	18,2%	18,7%	20,5%	23,2%
30.12.2019	bis	27.12.2021	25,1%	20,1%	22,4%	22,3%	23,0%	25,7%	26,3%	26,4%	26,4%	28,1%	36,8%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	53,1%	17,8%	23,6%	34,3%	40,3%	47,8%	53,2%	61,1%	61,0%	72,6%	80,5%
27.12.2004	bis	28.12.2009	57,0%	26,3%	44,9%	45,6%	53,3%	58,6%	67,9%	61,9%	65,2%	74,0%	82,2%
28.12.2009	bis	29.12.2014	31,2%	15,9%	21,9%	20,0%	26,4%	20,8%	25,9%	24,3%	31,4%	38,9%	46,9%
29.12.2014	bis	30.12.2019	25,5%	15,8%	15,0%	32,1%	21,7%	20,4%	31,2%	36,6%	19,7%	41,3%	38,6%
30.12.2019	bis	27.12.2021	36,2%	32,4%	35,1%	34,2%	34,0%	36,2%	39,0%	36,2%	31,9%	32,7%	48,4%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	20,4%	20,4%	-4,4%	11,7%	9,1%	28,7%	21,7%	13,3%	53,1%
27.12.2004	bis	28.12.2009	8,1%	9,8%	6,8%	13,7%	10,4%	23,5%	28,4%	19,3%	57,0%
28.12.2009	bis	29.12.2014	11,1%	8,9%	11,3%	13,1%	10,8%	19,5%	14,0%	10,1%	31,2%
29.12.2014	bis	30.12.2019	8,0%	6,9%	6,8%	12,6%	10,6%	17,4%	18,1%	17,5%	25,5%
30.12.2019	bis	27.12.2021	-1,1%	0,2%	9,2%	21,1%	14,3%	25,1%	35,0%	23,4%	36,2%

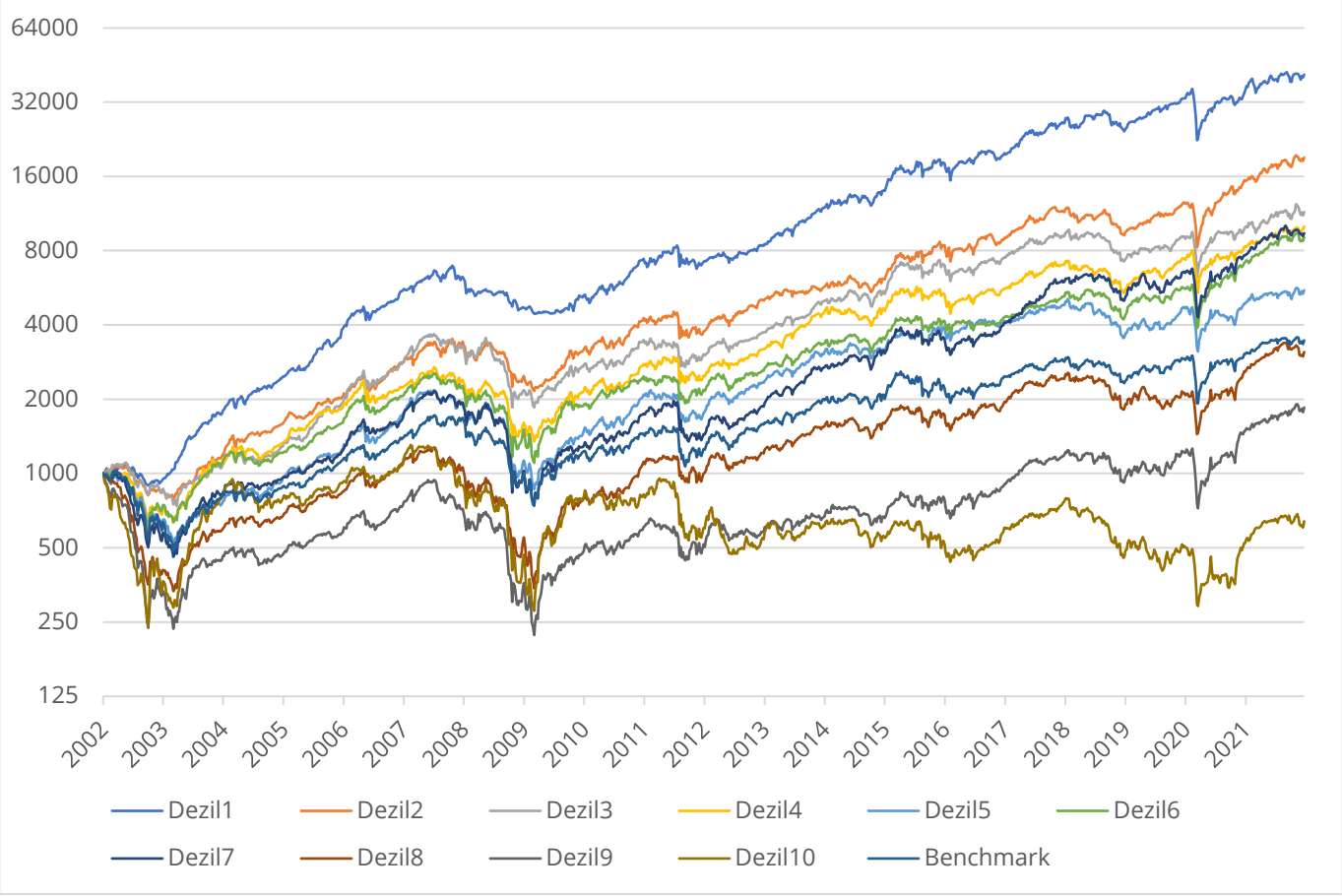
Technischer Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Deutschland
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	CDAX
Durchschnittliche Anzahl Aktien	166	Scoring-Modell:	Technischer Score

Dezilanalyse

	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	6,4%	20,4%	15,9%	13,0%	12,2%	8,9%	11,6%	11,8%	5,8%	3,1%	-2,2%
Annualisierte Volatilität	22,2%	17,2%	18,7%	19,2%	20,5%	21,0%	20,3%	23,1%	23,8%	27,1%	32,9%
Maximaler Drawdown	57,0%	38,1%	38,6%	49,7%	50,1%	60,4%	56,7%	65,1%	73,1%	77,9%	78,7%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,288	1,184	0,848	0,676	0,593	0,425	0,572	0,513	0,245	0,115	-0,067
Max 3 Jahre rollierend	152,7%	329,0%	188,7%	225,0%	227,1%	183,8%	204,2%	218,9%	239,4%	181,4%	265,7%
Min 3 Jahre rollierend	-40,2%	-17,0%	-15,4%	-26,1%	-36,5%	-40,9%	-42,4%	-48,6%	-64,0%	-66,6%	-73,0%
Max 5 Jahre rollierend	205,5%	653,3%	309,4%	320,3%	276,5%	263,1%	315,7%	306,3%	362,2%	234,2%	357,7%
Min 5 Jahre rollierend	-24,4%	12,0%	10,4%	-13,2%	0,7%	-13,2%	-10,9%	-27,3%	-44,7%	-53,4%	-68,3%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	85,9%	81,9%	73,4%	71,0%	63,3%	68,2%	74,6%	56,5%	47,6%	29,4%

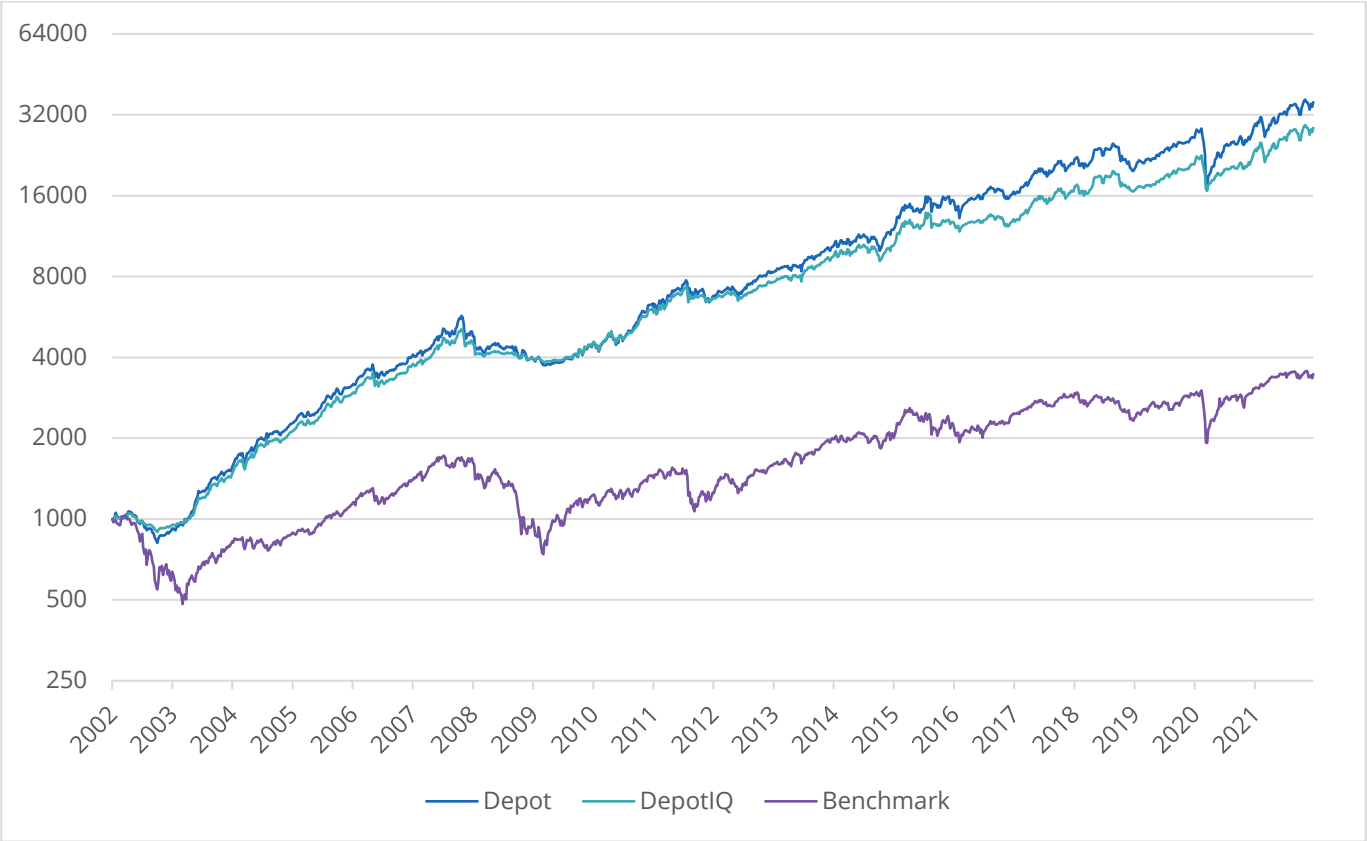


Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	19,5%	18,2%	6,4%
Annualisierte Volatilität	18,0%	14,8%	22,2%
Maximaler Drawdown	39,8%	26,3%	57,0%
Rendite-Risiko-Verhältnis	1,080	1,234	0,288

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Technisch	70%
Verkaufskriterium 2	Technisch	70%
Depotumschlagsfaktor	1,49	

Max 3 Jahre rollierend	275,6%	240,6%	152,7%
Min 3 Jahre rollierend	-10,0%	-1,7%	-40,2%
Max 5 Jahre rollierend	556,4%	449,7%	205,5%
Min 5 Jahre rollierend	17,4%	31,4%	-24,4%
Anteil Outperformance 1 Jahr	82,7%	79,0%	---



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	31,5%	29,7%	-26,5%
30.12.2002	bis	29.12.2003	30,0%	26,5%	54,4%
29.12.2003	bis	27.12.2004	41,2%	28,6%	-7,7%
27.12.2004	bis	26.12.2005	9,2%	13,8%	-8,5%
26.12.2005	bis	25.12.2006	5,5%	18,2%	0,5%
25.12.2006	bis	31.12.2007	3,2%	-3,4%	-31,3%
31.12.2007	bis	29.12.2008	24,1%	16,9%	-8,5%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-20,0%	-9,8%	30,9%
28.12.2009	bis	27.12.2010	25,2%	19,3%	-4,3%
27.12.2010	bis	26.12.2011	21,1%	8,1%	-6,5%
26.12.2011	bis	31.12.2012	-4,5%	-2,3%	-24,7%
31.12.2012	bis	30.12.2013	-2,0%	0,9%	-12,4%
30.12.2013	bis	29.12.2014	11,3%	8,9%	-8,5%
29.12.2014	bis	28.12.2015	19,9%	23,8%	-1,4%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-1,8%	-1,0%	2,4%
26.12.2016	bis	25.12.2017	12,4%	15,3%	14,5%
25.12.2017	bis	31.12.2018	12,5%	5,2%	-11,8%
31.12.2018	bis	30.12.2019	8,4%	11,2%	-3,2%
30.12.2019	bis	28.12.2020	2,9%	8,8%	7,0%
28.12.2020	bis	27.12.2021	11,8%	7,8%	10,3%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	-4,4%	34,7%	16,5%	8,7%	9,8%	-2,5%	6,6%	-1,7%	-12,8%	-22,7%	-8,2%
27.12.2004	bis	28.12.2009	6,8%	16,2%	14,6%	16,0%	9,9%	9,0%	9,0%	6,0%	3,1%	0,4%	0,1%
28.12.2009	bis	29.12.2014	11,3%	22,0%	14,6%	15,1%	16,9%	17,2%	13,7%	19,7%	15,7%	7,1%	-6,4%
29.12.2014	bis	30.12.2019	6,8%	18,8%	15,2%	10,8%	9,8%	8,2%	9,7%	15,8%	5,7%	12,8%	-1,9%
30.12.2019	bis	27.12.2021	9,2%	11,6%	23,3%	12,0%	16,0%	8,2%	26,4%	19,8%	21,0%	23,1%	12,2%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	28,7%	13,7%	14,8%	17,9%	20,1%	20,5%	21,4%	25,3%	26,8%	34,8%	45,9%
27.12.2004	bis	28.12.2009	23,5%	16,1%	20,2%	22,0%	24,1%	25,8%	25,3%	28,7%	30,2%	31,2%	37,3%
28.12.2009	bis	29.12.2014	19,5%	17,4%	18,9%	17,7%	19,4%	18,4%	16,5%	19,1%	18,3%	21,4%	26,6%
29.12.2014	bis	30.12.2019	17,4%	16,3%	16,9%	15,8%	16,5%	16,3%	15,3%	17,2%	17,9%	20,1%	22,7%
30.12.2019	bis	27.12.2021	25,1%	25,0%	23,6%	24,4%	23,6%	24,7%	24,1%	26,0%	25,8%	31,0%	34,5%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	53,1%	17,9%	27,4%	33,3%	38,0%	49,4%	43,7%	54,2%	66,7%	76,6%	76,0%
27.12.2004	bis	28.12.2009	57,0%	36,2%	38,6%	49,7%	50,1%	60,4%	56,7%	65,1%	73,1%	76,5%	78,7%
28.12.2009	bis	29.12.2014	31,2%	19,6%	22,1%	23,6%	22,1%	25,6%	22,7%	31,7%	22,1%	32,3%	50,5%
29.12.2014	bis	30.12.2019	25,5%	17,9%	23,3%	25,5%	26,2%	30,4%	24,3%	22,6%	29,0%	26,2%	49,2%
30.12.2019	bis	27.12.2021	36,2%	38,1%	34,3%	34,2%	32,7%	34,0%	33,3%	36,6%	33,0%	42,9%	42,9%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	31,4%	28,4%	-4,4%	13,9%	11,6%	28,7%	23,7%	14,8%	53,1%
27.12.2004	bis	28.12.2009	14,0%	15,8%	6,8%	15,6%	13,0%	23,5%	34,6%	24,4%	57,0%
28.12.2009	bis	29.12.2014	22,2%	18,7%	11,3%	18,1%	14,9%	19,5%	17,2%	13,1%	31,2%
29.12.2014	bis	30.12.2019	17,1%	15,0%	6,8%	17,4%	15,1%	17,4%	21,0%	16,1%	25,5%
30.12.2019	bis	27.12.2021	16,3%	16,9%	9,2%	28,1%	20,9%	25,1%	39,8%	26,3%	36,2%

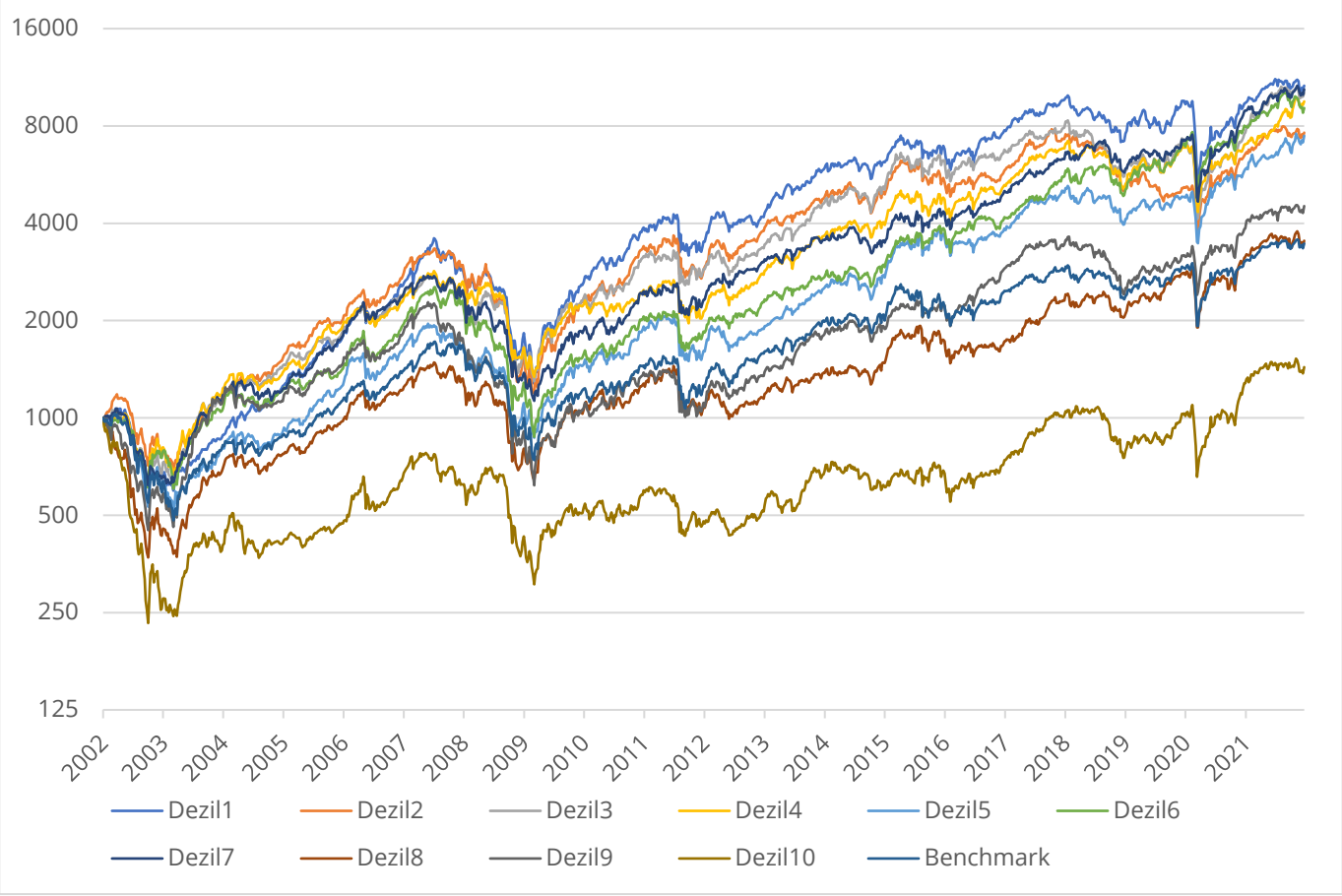
Value-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Deutschland
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	CDAX
Durchschnittliche Anzahl Aktien	160	Scoring-Modell:	Value-Score

Dezilanalyse

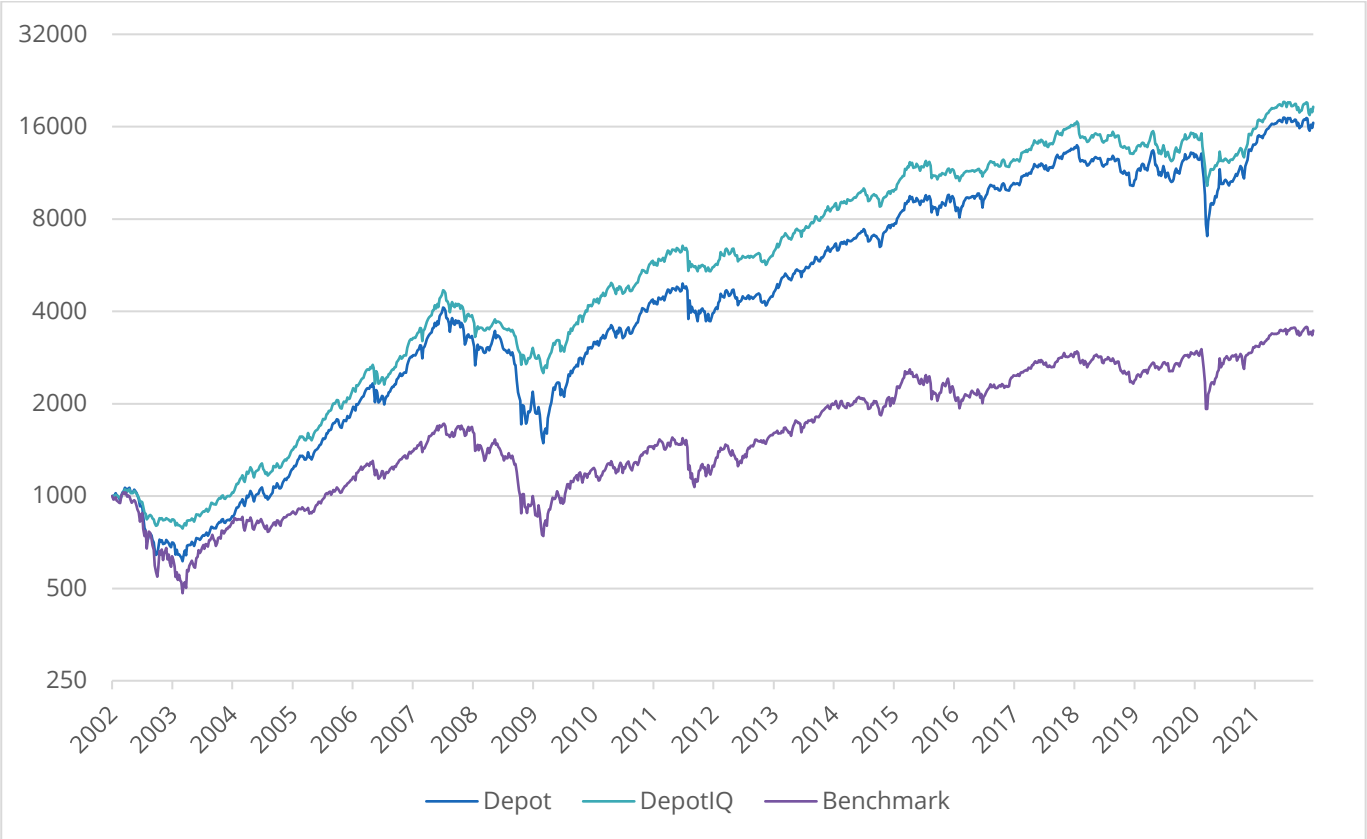
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	6,4%	12,5%	10,7%	12,2%	11,9%	10,6%	11,6%	12,4%	6,5%	7,8%	1,8%
Annualisierte Volatilität	22,2%	22,1%	22,2%	22,3%	20,8%	21,5%	21,5%	20,2%	22,3%	23,2%	25,2%
Maximaler Drawdown	57,0%	64,6%	64,4%	53,1%	53,0%	57,1%	65,5%	59,0%	63,0%	72,9%	76,8%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,288	0,566	0,481	0,548	0,572	0,490	0,543	0,612	0,292	0,338	0,072
Max 3 Jahre rollierend	152,7%	240,9%	233,9%	243,2%	217,6%	192,8%	180,8%	219,2%	207,2%	253,6%	137,5%
Min 3 Jahre rollierend	-40,2%	-37,3%	-48,1%	-41,4%	-37,0%	-42,0%	-48,4%	-45,1%	-42,8%	-61,8%	-59,2%
Max 5 Jahre rollierend	205,5%	422,9%	353,4%	322,9%	323,6%	233,3%	284,2%	323,2%	275,9%	334,5%	193,7%
Min 5 Jahre rollierend	-24,4%	-27,5%	-36,8%	-34,8%	-19,3%	-15,5%	-24,2%	-11,0%	-30,4%	-48,3%	-42,2%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	70,6%	64,5%	69,0%	69,0%	71,8%	69,8%	67,7%	57,3%	53,6%	45,2%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	15,0%	15,7%	6,4%
Annualisierte Volatilität	23,0%	17,2%	22,2%
Maximaler Drawdown	63,9%	46,4%	57,0%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,652	0,910	0,288
Max 3 Jahre rollierend	307,3%	287,9%	152,7%
Min 3 Jahre rollierend	-36,5%	-22,4%	-40,2%
Max 5 Jahre rollierend	482,6%	429,9%	205,5%
Min 5 Jahre rollierend	-23,2%	-13,3%	-24,4%
Anteil Outperformance 1 Jahr	76,2%	75,8%	---

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Value	90%
Verkaufskriterium 2	Value	90%
Depotumschlagsfaktor	1,11	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	9,3%	12,0%	-18,6%
30.12.2002	bis	29.12.2003	-13,4%	4,5%	39,7%
29.12.2003	bis	27.12.2004	34,5%	28,2%	-5,0%
27.12.2004	bis	26.12.2005	24,6%	8,2%	-6,5%
26.12.2005	bis	25.12.2006	32,0%	18,5%	7,2%
25.12.2006	bis	31.12.2007	-5,5%	-10,5%	-24,5%
31.12.2007	bis	29.12.2008	6,2%	-0,4%	2,1%
29.12.2008	bis	28.12.2009	17,4%	20,3%	-7,8%
28.12.2009	bis	27.12.2010	25,0%	29,1%	2,7%
27.12.2010	bis	26.12.2011	3,8%	1,1%	-4,0%
26.12.2011	bis	31.12.2012	-12,9%	0,3%	-12,6%
31.12.2012	bis	30.12.2013	17,2%	6,6%	5,1%
30.12.2013	bis	29.12.2014	14,8%	0,9%	-4,4%
29.12.2014	bis	28.12.2015	14,8%	1,9%	4,2%
28.12.2015	bis	26.12.2016	1,7%	-0,4%	9,2%
26.12.2016	bis	25.12.2017	13,2%	9,5%	12,1%
25.12.2017	bis	31.12.2018	-5,2%	-9,2%	-8,3%
31.12.2018	bis	30.12.2019	2,6%	-7,2%	9,5%
30.12.2019	bis	28.12.2020	1,8%	6,5%	17,2%
28.12.2020	bis	27.12.2021	4,4%	2,2%	1,5%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	-4,4%	7,4%	14,6%	12,6%	10,9%	-3,8%	6,6%	6,7%	-8,5%	4,2%	-26,0%
27.12.2004	bis	28.12.2009	6,8%	15,8%	8,8%	10,0%	10,2%	10,2%	4,9%	8,5%	6,0%	-1,4%	4,5%
28.12.2009	bis	29.12.2014	11,3%	19,0%	16,9%	17,6%	12,7%	13,8%	14,1%	14,1%	7,6%	12,7%	4,1%
29.12.2014	bis	30.12.2019	6,8%	9,1%	0,6%	6,5%	11,3%	11,7%	18,7%	15,4%	13,6%	10,6%	10,7%
30.12.2019	bis	27.12.2021	9,2%	5,5%	21,4%	19,1%	17,4%	24,3%	13,5%	19,5%	12,1%	19,1%	17,9%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	28,7%	18,3%	21,0%	24,1%	25,8%	25,0%	24,1%	20,2%	30,2%	29,5%	36,5%
27.12.2004	bis	28.12.2009	23,5%	26,9%	28,5%	25,3%	21,8%	24,7%	25,8%	23,0%	23,1%	27,9%	26,2%
28.12.2009	bis	29.12.2014	19,5%	20,1%	19,9%	19,5%	18,2%	18,9%	17,1%	18,3%	19,5%	19,7%	19,9%
29.12.2014	bis	30.12.2019	17,4%	17,3%	17,3%	18,3%	17,3%	17,0%	16,6%	16,3%	16,5%	15,8%	18,5%
30.12.2019	bis	27.12.2021	25,1%	29,1%	22,6%	27,4%	24,4%	23,9%	25,6%	26,1%	26,0%	23,4%	28,5%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	53,1%	44,3%	41,8%	42,9%	39,3%	49,6%	39,7%	42,3%	63,0%	55,0%	76,8%
27.12.2004	bis	28.12.2009	57,0%	64,6%	64,4%	53,1%	53,0%	57,1%	65,5%	59,0%	56,9%	72,9%	60,8%
28.12.2009	bis	29.12.2014	31,2%	25,5%	26,6%	21,9%	26,4%	27,6%	24,2%	20,3%	31,4%	28,2%	29,1%
29.12.2014	bis	30.12.2019	25,5%	28,3%	40,2%	33,1%	28,8%	24,0%	20,0%	20,7%	23,3%	33,7%	30,8%
30.12.2019	bis	27.12.2021	36,2%	45,1%	27,5%	42,4%	37,7%	30,8%	37,6%	38,0%	34,4%	29,4%	40,1%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	6,4%	11,7%	-4,4%	18,4%	12,8%	28,7%	42,5%	25,6%	53,1%
27.12.2004	bis	28.12.2009	20,2%	24,4%	6,8%	28,0%	20,5%	23,5%	63,9%	46,4%	57,0%
28.12.2009	bis	29.12.2014	20,3%	18,9%	11,3%	20,2%	15,8%	19,5%	24,7%	17,5%	31,2%
29.12.2014	bis	30.12.2019	11,3%	8,9%	6,8%	18,4%	15,3%	17,4%	26,3%	25,7%	25,5%
30.12.2019	bis	27.12.2021	12,2%	10,4%	9,2%	31,3%	21,7%	25,1%	46,3%	32,6%	36,2%

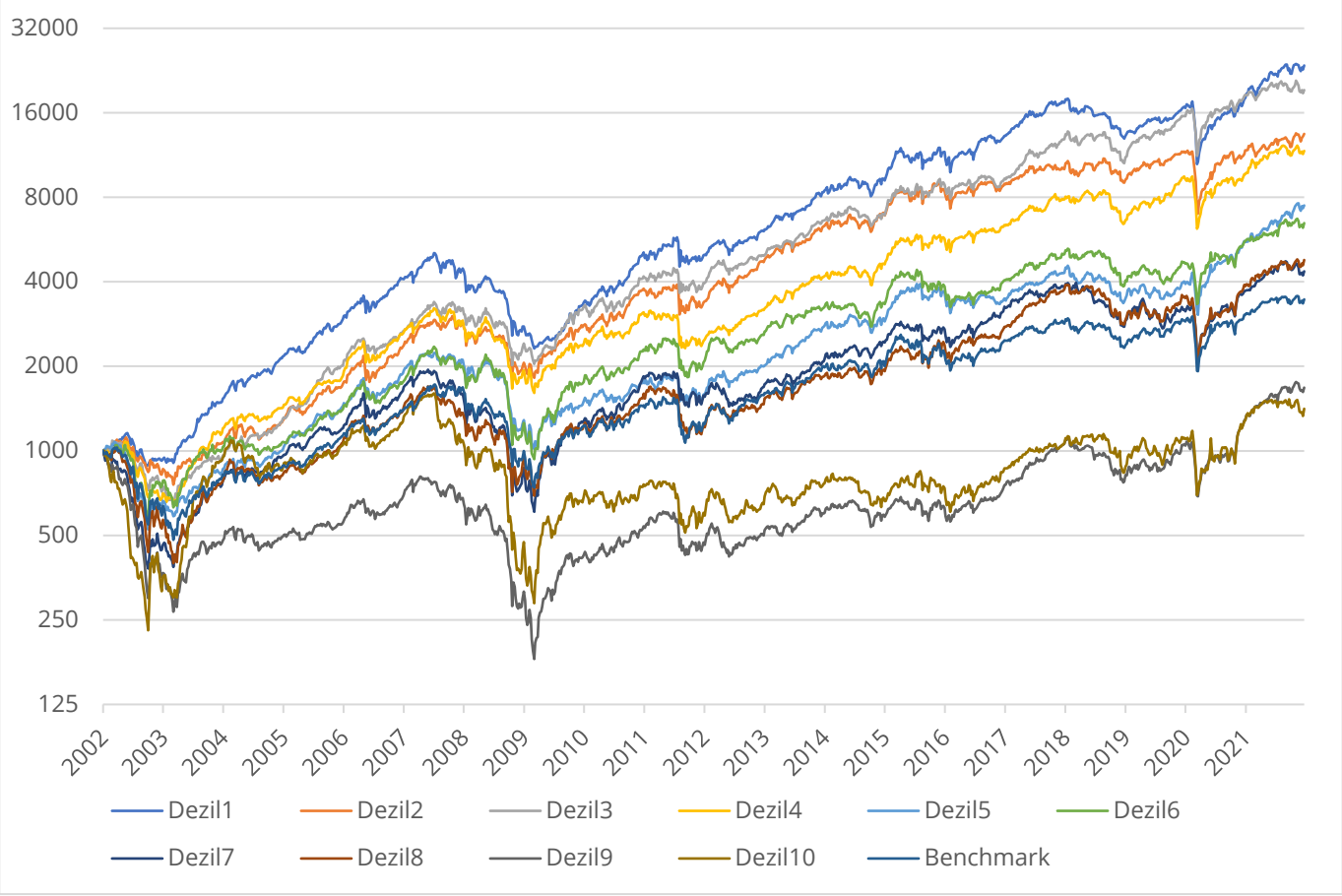
Kombi-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Deutschland
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	CDAX
Durchschnittliche Anzahl Aktien	160	Scoring-Modell:	Kombi-Score

Dezilanalyse

	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	6,4%	17,1%	13,9%	15,9%	13,1%	10,6%	9,8%	7,6%	8,1%	2,6%	1,7%
Annualisierte Volatilität	22,2%	19,2%	19,6%	18,5%	19,0%	20,6%	21,8%	23,8%	24,6%	25,6%	31,7%
Maximaler Drawdown	57,0%	54,3%	40,4%	41,1%	50,1%	54,6%	60,2%	68,8%	61,0%	81,8%	82,1%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,288	0,891	0,707	0,860	0,686	0,513	0,447	0,320	0,331	0,102	0,055
Max 3 Jahre rollierend	152,7%	255,9%	158,8%	264,8%	246,0%	173,0%	166,1%	268,6%	215,3%	191,3%	329,9%
Min 3 Jahre rollierend	-40,2%	-31,4%	-25,0%	-15,2%	-27,5%	-39,8%	-42,3%	-57,2%	-45,5%	-71,1%	-75,4%
Max 5 Jahre rollierend	205,5%	433,8%	257,2%	360,9%	357,3%	311,7%	260,7%	350,0%	246,6%	247,6%	449,2%
Min 5 Jahre rollierend	-24,4%	-8,8%	-16,4%	31,9%	-15,2%	-22,4%	-19,5%	-25,7%	-22,0%	-63,8%	-71,7%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	77,8%	76,6%	85,1%	79,8%	62,9%	60,1%	62,9%	53,6%	44,4%	36,7%

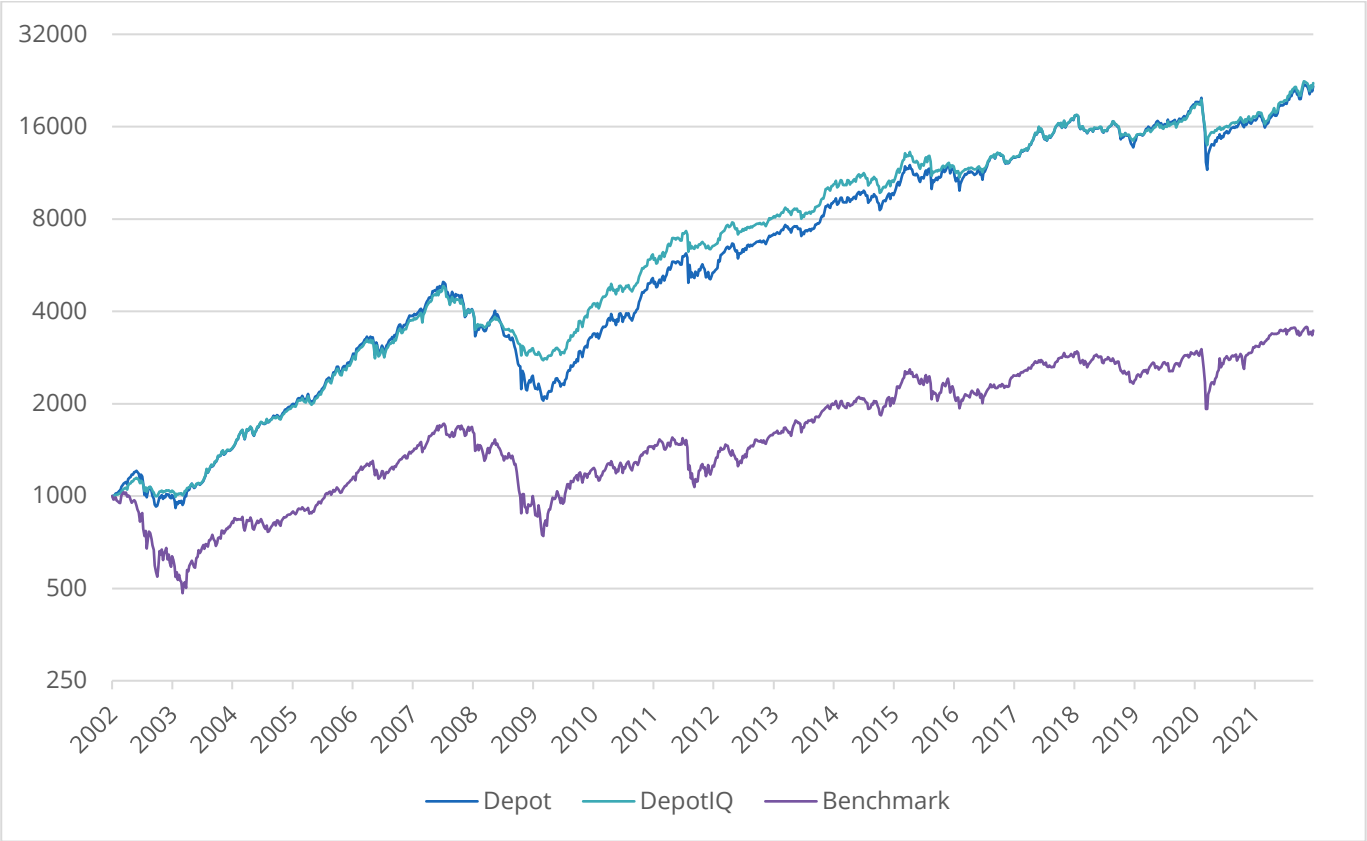


Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	16,6%	16,7%	6,4%
Annualisierte Volatilität	20,0%	15,6%	22,2%
Maximaler Drawdown	59,0%	42,7%	57,0%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,830	1,070	0,288

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Kombi	70%
Verkaufskriterium 2	Kombi	70%
Depotumschlagsfaktor	1,05	

Max 3 Jahre rollierend	235,4%	206,0%	152,7%
Min 3 Jahre rollierend	-37,4%	-13,9%	-40,2%
Max 5 Jahre rollierend	392,9%	362,3%	205,5%
Min 5 Jahre rollierend	-1,3%	7,9%	-24,4%
Anteil Outperformance 1 Jahr	75,8%	75,0%	---



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	39,6%	28,4%	-25,3%
30.12.2002	bis	29.12.2003	6,5%	8,5%	75,2%
29.12.2003	bis	27.12.2004	30,2%	22,4%	-10,0%
27.12.2004	bis	26.12.2005	11,9%	6,0%	-12,2%
26.12.2005	bis	25.12.2006	17,6%	17,0%	-0,7%
25.12.2006	bis	31.12.2007	-16,7%	-5,8%	-28,0%
31.12.2007	bis	29.12.2008	4,0%	9,8%	-14,0%
29.12.2008	bis	28.12.2009	5,6%	-0,4%	15,5%
28.12.2009	bis	27.12.2010	35,7%	25,3%	1,5%
27.12.2010	bis	26.12.2011	18,6%	8,4%	-1,8%
26.12.2011	bis	31.12.2012	5,5%	3,5%	-19,8%
31.12.2012	bis	30.12.2013	0,8%	9,2%	-7,8%
30.12.2013	bis	29.12.2014	3,5%	7,6%	-10,1%
29.12.2014	bis	28.12.2015	11,1%	13,6%	-0,5%
28.12.2015	bis	26.12.2016	0,8%	0,5%	6,9%
26.12.2016	bis	25.12.2017	17,3%	6,8%	16,6%
25.12.2017	bis	31.12.2018	-0,4%	0,6%	-4,4%
31.12.2018	bis	30.12.2019	12,8%	4,4%	9,2%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-15,6%	-2,6%	12,9%
28.12.2020	bis	27.12.2021	14,9%	11,2%	7,6%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	-4,4%	29,0%	8,1%	8,3%	12,5%	0,1%	2,2%	-1,7%	-6,7%	-21,1%	-5,3%
27.12.2004	bis	28.12.2009	6,8%	9,0%	16,9%	20,2%	10,7%	7,8%	10,2%	5,8%	7,9%	-3,3%	-5,1%
28.12.2009	bis	29.12.2014	11,3%	23,0%	20,6%	16,9%	14,4%	15,2%	14,1%	14,2%	10,2%	7,2%	0,8%
29.12.2014	bis	30.12.2019	6,8%	12,5%	10,5%	17,4%	15,3%	6,2%	6,9%	5,4%	12,7%	12,2%	10,3%
30.12.2019	bis	27.12.2021	9,2%	18,4%	7,6%	11,3%	11,1%	36,7%	17,5%	16,9%	16,3%	26,3%	12,6%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	28,7%	15,4%	18,3%	19,1%	18,1%	20,7%	24,7%	28,0%	33,9%	33,4%	45,4%
27.12.2004	bis	28.12.2009	23,5%	20,7%	21,0%	19,9%	21,7%	24,9%	26,1%	29,2%	27,1%	31,0%	35,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	19,5%	19,2%	19,2%	17,1%	17,8%	18,3%	18,2%	19,0%	19,0%	20,1%	24,2%
29.12.2014	bis	30.12.2019	17,4%	16,5%	16,5%	16,2%	15,8%	16,0%	17,3%	17,9%	18,4%	17,4%	21,0%
30.12.2019	bis	27.12.2021	25,1%	25,5%	25,6%	22,7%	23,6%	24,0%	24,7%	26,2%	27,3%	27,0%	34,3%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	53,1%	23,3%	32,2%	41,1%	39,3%	51,2%	44,2%	61,9%	61,0%	73,3%	77,1%
27.12.2004	bis	28.12.2009	57,0%	54,3%	39,7%	40,6%	50,1%	54,6%	60,2%	68,8%	59,2%	77,6%	82,1%
28.12.2009	bis	29.12.2014	31,2%	21,3%	21,9%	18,4%	26,5%	20,6%	27,1%	25,1%	34,1%	30,8%	34,7%
29.12.2014	bis	30.12.2019	25,5%	27,9%	19,2%	22,9%	24,1%	26,6%	26,6%	31,2%	27,9%	30,5%	28,3%
30.12.2019	bis	27.12.2021	36,2%	40,3%	40,4%	32,1%	34,9%	29,3%	29,1%	36,2%	41,3%	36,3%	40,9%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	25,3%	24,6%	-4,4%	16,1%	11,3%	28,7%	24,5%	13,4%	53,1%
27.12.2004	bis	28.12.2009	10,9%	16,4%	6,8%	22,9%	17,8%	23,5%	59,0%	42,7%	57,0%
28.12.2009	bis	29.12.2014	24,1%	20,9%	11,3%	19,6%	15,8%	19,5%	19,8%	14,4%	31,2%
29.12.2014	bis	30.12.2019	14,2%	11,7%	6,8%	16,8%	14,3%	17,4%	21,4%	17,7%	25,5%
30.12.2019	bis	27.12.2021	7,1%	9,2%	9,2%	25,1%	18,0%	25,1%	41,8%	28,8%	36,2%

England – FTSE350

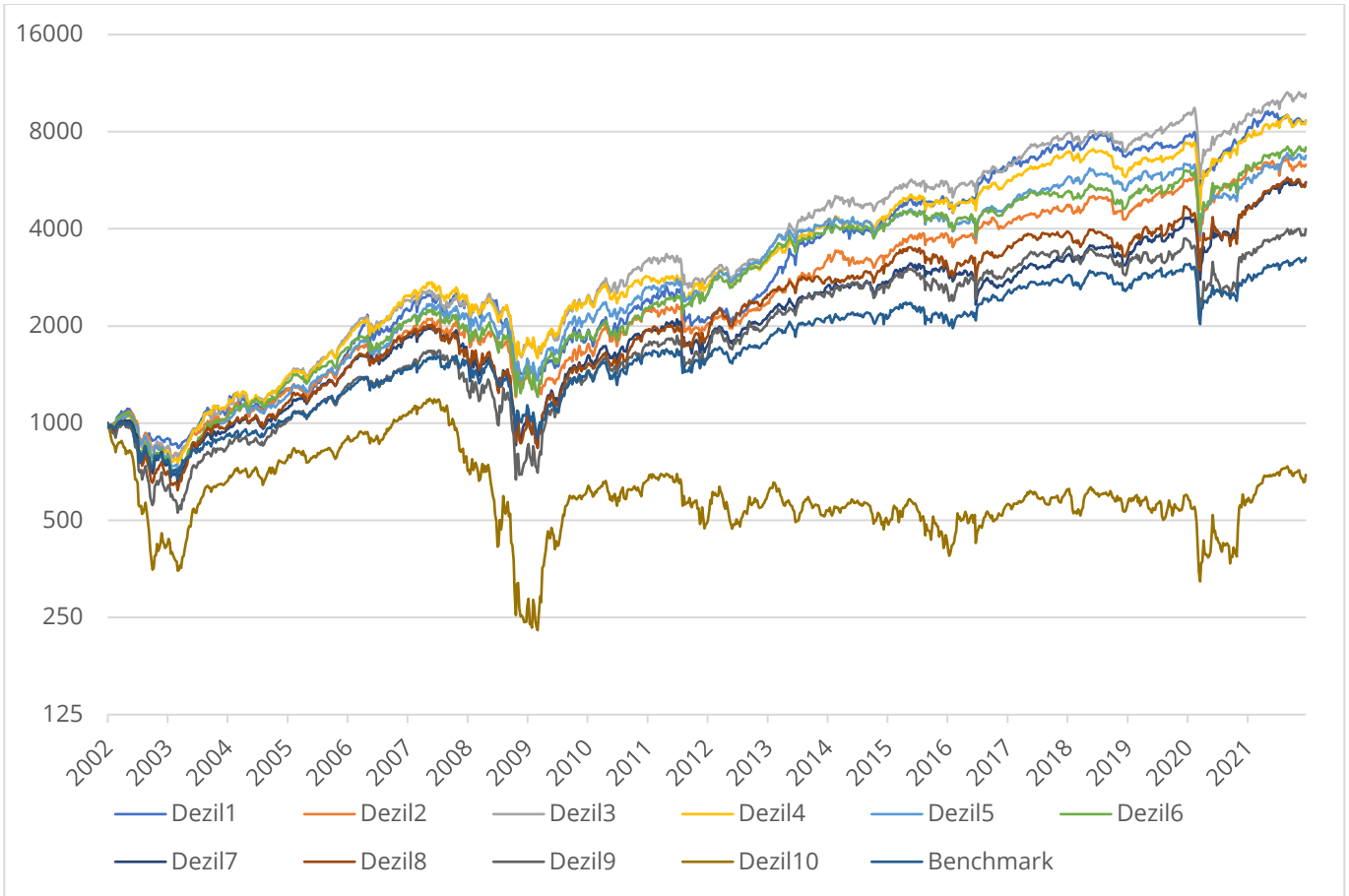
Trend-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	England
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	FTSE350
Durchschnittliche Anzahl Aktien	340	Scoring-Modell:	Trend-Score

Dezilanalyse

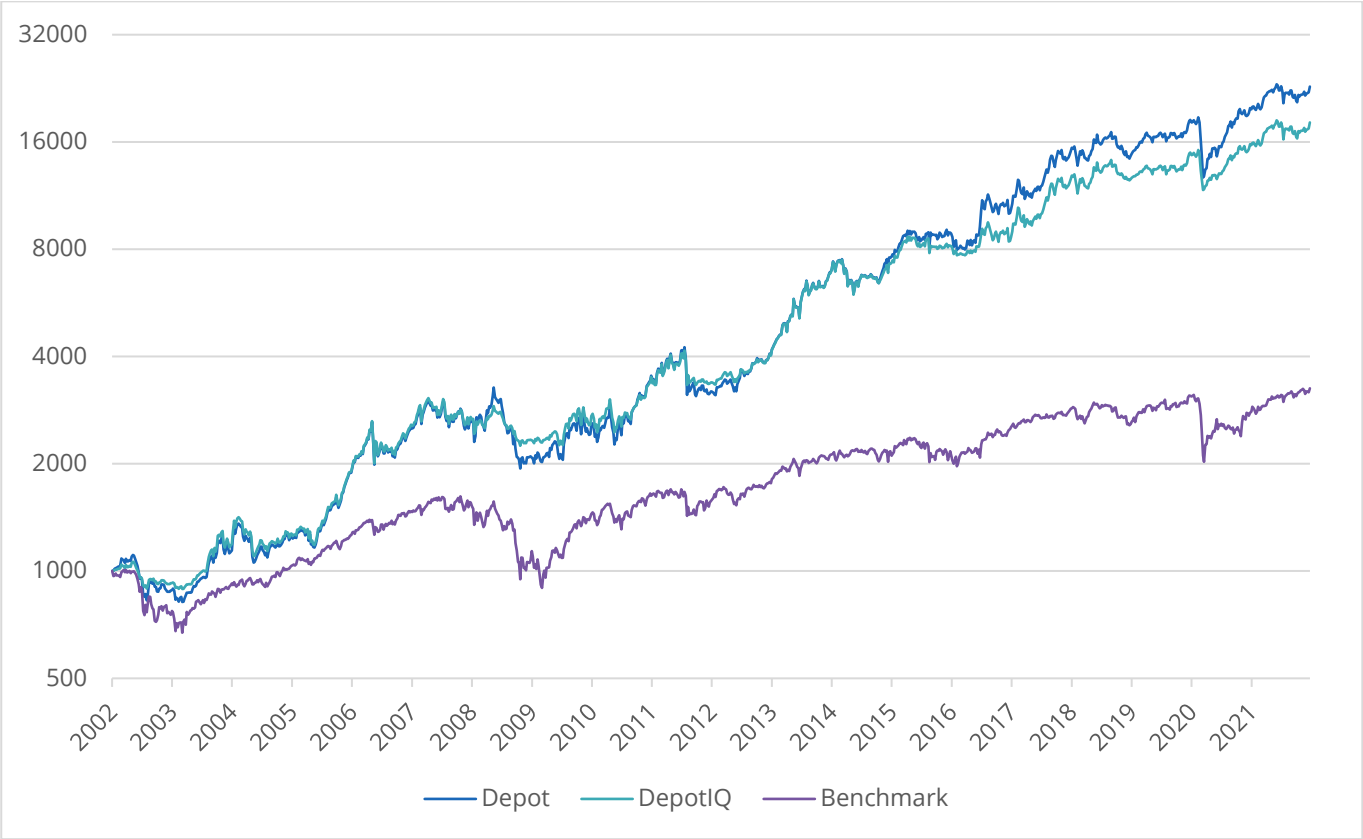
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	6,1%	11,4%	9,6%	12,4%	11,4%	10,0%	10,3%	9,0%	9,0%	7,2%	-1,8%
Annualisierte Volatilität	17,8%	18,6%	17,3%	17,1%	17,0%	17,4%	18,1%	19,8%	20,6%	22,8%	30,3%
Maximaler Drawdown	44,7%	45,5%	42,9%	40,4%	43,8%	42,1%	46,7%	57,4%	58,6%	60,2%	80,9%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,341	0,611	0,557	0,729	0,668	0,574	0,569	0,453	0,435	0,313	-0,060
Max 3 Jahre rollierend	98,9%	141,7%	120,5%	162,8%	168,2%	146,0%	172,4%	142,8%	160,8%	169,9%	165,1%
Min 3 Jahre rollierend	-33,7%	-30,2%	-28,9%	-22,2%	-21,4%	-24,6%	-33,6%	-46,9%	-48,2%	-49,1%	-75,3%
Max 5 Jahre rollierend	138,0%	228,2%	179,4%	207,8%	228,7%	219,4%	237,0%	213,3%	228,7%	275,8%	189,8%
Min 5 Jahre rollierend	-11,3%	-16,9%	-5,8%	8,3%	-4,4%	-13,6%	-10,7%	-15,5%	-17,8%	-22,5%	-68,0%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	69,8%	69,4%	82,3%	78,6%	75,4%	72,6%	76,6%	69,0%	66,1%	31,9%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	16,9%	15,5%	6,1%
Annualisierte Volatilität	23,5%	20,0%	17,8%
Maximaler Drawdown	40,7%	26,5%	44,7%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,719	0,777	0,341
Max 3 Jahre rollierend	194,0%	182,6%	98,9%
Min 3 Jahre rollierend	-19,9%	-14,8%	-33,7%
Max 5 Jahre rollierend	295,1%	251,3%	138,0%
Min 5 Jahre rollierend	11,7%	15,3%	-11,3%
Anteil Outperformance 1 Jahr	79,0%	74,6%	---

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Trend	70%
Verkaufskriterium 2	Trend	70%
Depotumschlagsfaktor	1,72	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	12,9%	11,1%	-23,9%
30.12.2002	bis	29.12.2003	7,3%	1,1%	25,9%
29.12.2003	bis	27.12.2004	-2,5%	7,7%	5,6%
27.12.2004	bis	26.12.2005	28,9%	4,6%	0,6%
26.12.2005	bis	25.12.2006	15,6%	12,9%	0,4%
25.12.2006	bis	31.12.2007	1,1%	-2,8%	-23,2%
31.12.2007	bis	29.12.2008	9,7%	-3,1%	-25,3%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-17,2%	-9,3%	82,3%
28.12.2009	bis	27.12.2010	25,0%	16,3%	1,5%
27.12.2010	bis	26.12.2011	-2,2%	-6,1%	-12,5%
26.12.2011	bis	31.12.2012	15,0%	7,5%	10,3%
31.12.2012	bis	30.12.2013	49,9%	25,6%	-10,1%
30.12.2013	bis	29.12.2014	7,7%	3,4%	-2,7%
29.12.2014	bis	28.12.2015	17,6%	16,4%	-5,7%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-1,8%	-1,6%	0,8%
26.12.2016	bis	25.12.2017	32,9%	3,4%	0,6%
25.12.2017	bis	31.12.2018	7,6%	1,4%	-4,5%
31.12.2018	bis	30.12.2019	6,4%	3,3%	-0,8%
30.12.2019	bis	28.12.2020	18,2%	14,2%	3,8%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-2,1%	-9,6%	1,9%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	1,0%	8,5%	8,2%	10,9%	11,5%	6,6%	10,1%	3,5%	4,8%	0,1%	-8,7%
27.12.2004	bis	28.12.2009	6,6%	7,2%	5,7%	11,8%	11,3%	11,6%	6,9%	7,0%	5,2%	6,5%	-4,4%
28.12.2009	bis	29.12.2014	8,8%	18,8%	14,6%	15,9%	13,1%	14,5%	17,3%	12,1%	16,0%	14,2%	-3,5%
29.12.2014	bis	30.12.2019	7,4%	12,5%	11,3%	12,5%	11,0%	8,9%	7,9%	9,5%	8,5%	6,8%	3,3%
30.12.2019	bis	27.12.2021	2,5%	5,6%	5,8%	7,8%	8,2%	3,1%	8,6%	13,4%	9,1%	3,5%	7,4%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	18,9%	14,2%	13,0%	13,6%	14,7%	13,8%	16,1%	16,5%	16,9%	21,0%	25,3%
27.12.2004	bis	28.12.2009	20,7%	21,8%	20,3%	20,3%	20,1%	21,3%	23,3%	26,1%	26,7%	29,4%	39,7%
28.12.2009	bis	29.12.2014	15,5%	20,1%	17,0%	16,4%	14,7%	14,7%	14,4%	15,7%	15,5%	17,1%	22,5%
29.12.2014	bis	30.12.2019	14,0%	13,5%	12,7%	12,3%	12,5%	13,6%	13,6%	14,9%	16,5%	16,9%	23,9%
30.12.2019	bis	27.12.2021	22,1%	22,9%	24,2%	23,8%	25,4%	25,1%	23,9%	25,2%	27,8%	30,9%	40,4%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	33,3%	24,5%	28,8%	26,7%	29,0%	33,4%	37,5%	36,3%	38,5%	47,3%	65,1%
27.12.2004	bis	28.12.2009	44,7%	45,5%	42,9%	40,4%	43,8%	42,1%	46,7%	57,4%	58,6%	60,2%	80,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	15,8%	24,5%	18,5%	21,5%	16,0%	14,9%	13,3%	21,7%	14,5%	19,7%	32,9%
29.12.2014	bis	30.12.2019	16,8%	14,8%	15,6%	13,9%	18,2%	18,5%	16,3%	25,7%	21,7%	20,6%	33,3%
30.12.2019	bis	27.12.2021	35,0%	36,2%	37,2%	39,2%	38,1%	40,1%	34,9%	36,0%	36,4%	41,0%	46,1%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	7,7%	8,3%	1,0%	19,6%	16,9%	18,9%	26,2%	22,3%	33,3%
27.12.2004	bis	28.12.2009	14,1%	15,1%	6,6%	26,8%	22,7%	20,7%	40,7%	26,5%	44,7%
28.12.2009	bis	29.12.2014	25,5%	23,0%	8,8%	26,0%	22,5%	15,5%	27,2%	20,2%	15,8%
29.12.2014	bis	30.12.2019	19,4%	15,4%	7,4%	19,7%	17,1%	14,0%	15,8%	12,4%	16,8%
30.12.2019	bis	27.12.2021	11,4%	10,2%	2,5%	22,4%	17,5%	22,1%	32,2%	22,7%	35,0%

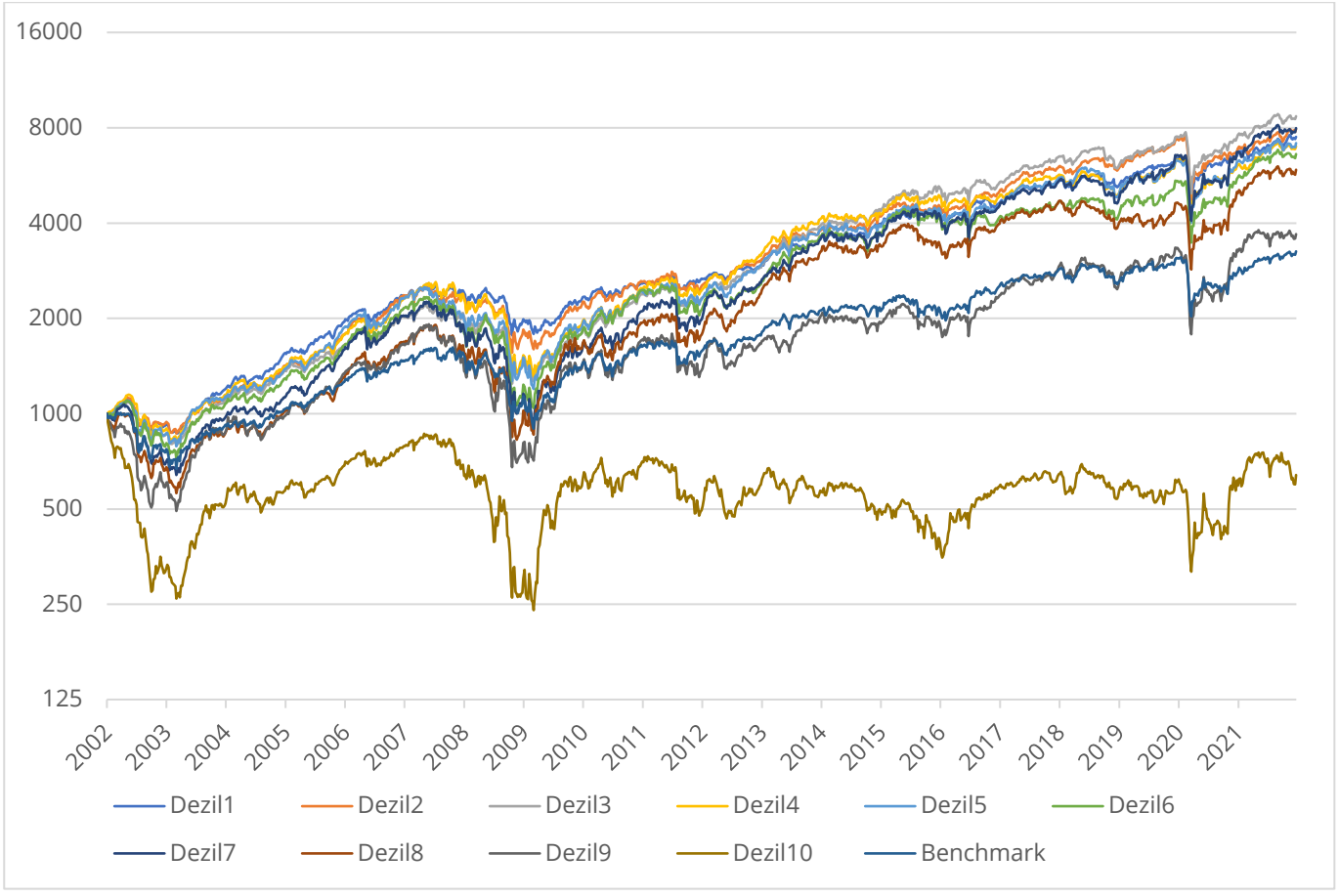
Safety-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	England
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	FTSE350
Durchschnittliche Anzahl Aktien	341	Scoring-Modell:	Safety-Score

Dezilanalyse

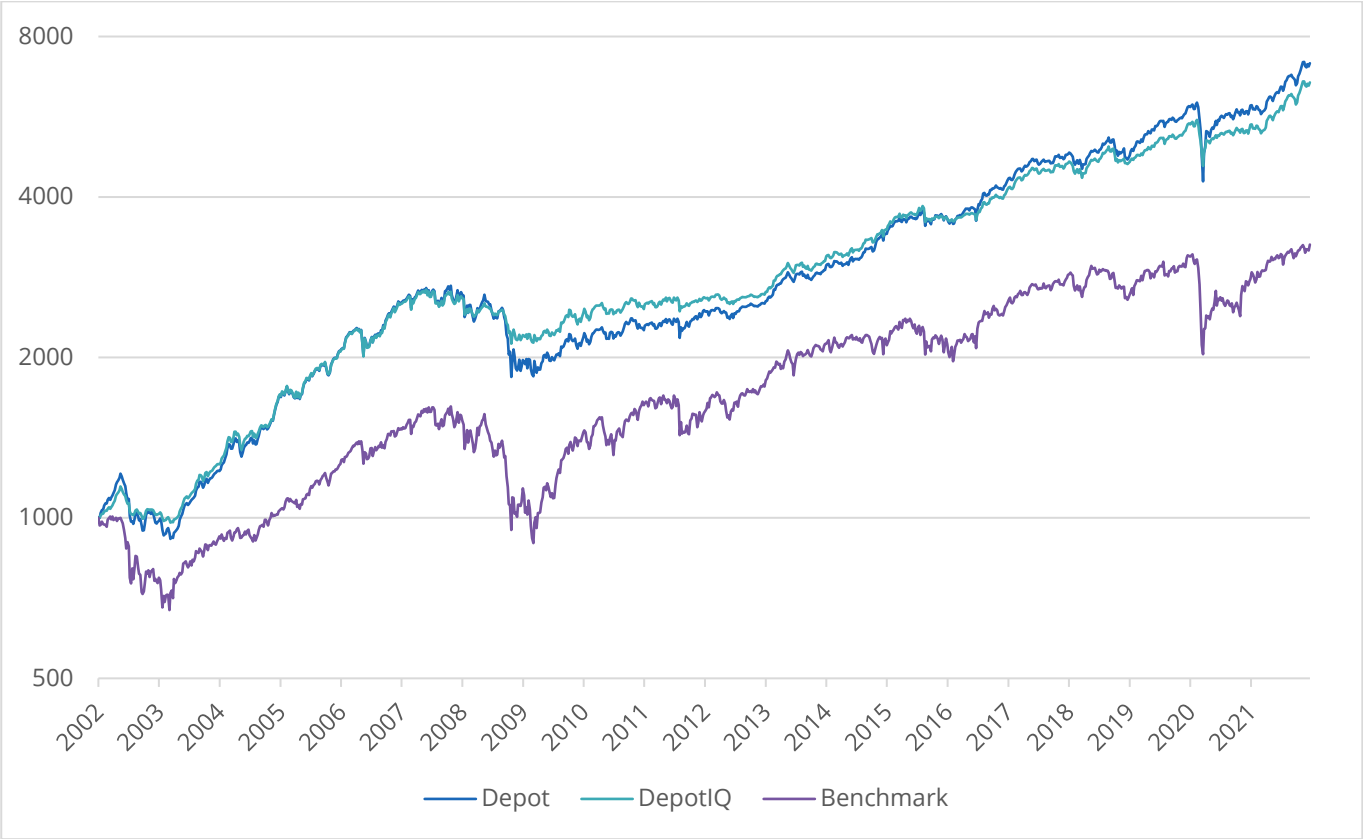
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	6,1%	10,6%	10,9%	11,4%	10,2%	10,3%	9,9%	10,9%	9,3%	6,7%	-2,2%
Annualisierte Volatilität	17,8%	12,8%	14,8%	15,3%	16,5%	18,3%	19,5%	21,1%	22,2%	24,5%	31,2%
Maximaler Drawdown	44,7%	31,4%	38,2%	43,5%	49,7%	52,3%	55,8%	58,8%	56,6%	64,7%	76,1%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,341	0,827	0,737	0,746	0,619	0,564	0,507	0,518	0,418	0,275	-0,071
Max 3 Jahre rollierend	98,9%	140,1%	126,9%	123,7%	135,3%	153,2%	147,1%	174,7%	155,3%	191,7%	184,3%
Min 3 Jahre rollierend	-33,7%	-14,9%	-19,4%	-28,3%	-31,6%	-39,8%	-41,5%	-46,1%	-41,3%	-50,0%	-67,0%
Max 5 Jahre rollierend	138,0%	178,5%	167,0%	220,4%	220,5%	227,3%	261,6%	298,7%	297,3%	238,3%	199,8%
Min 5 Jahre rollierend	-11,3%	3,7%	3,9%	4,2%	-9,5%	-5,1%	-16,7%	-9,0%	-23,3%	-26,6%	-58,2%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	73,8%	80,7%	79,4%	73,8%	79,0%	69,4%	74,6%	64,5%	60,5%	32,7%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	10,3%	9,8%	6,1%
Annualisierte Volatilität	12,3%	9,2%	17,8%
Maximaler Drawdown	32,5%	20,9%	44,7%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,835	1,068	0,341
Max 3 Jahre rollierend	145,0%	128,1%	98,9%
Min 3 Jahre rollierend	-19,5%	-9,8%	-33,7%
Max 5 Jahre rollierend	181,4%	162,4%	138,0%
Min 5 Jahre rollierend	-11,7%	-5,4%	-11,3%
Anteil Outperformance 1 Jahr	66,1%	62,1%	---

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Safety	80%
Verkaufskriterium 2	Safety	80%
Depotumschlagsfaktor	0,52	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	22,9%	17,0%	-30,3%
30.12.2002	bis	29.12.2003	3,8%	3,5%	33,7%
29.12.2003	bis	27.12.2004	24,6%	15,7%	-0,8%
27.12.2004	bis	26.12.2005	0,1%	3,7%	6,4%
26.12.2005	bis	25.12.2006	6,3%	10,2%	2,4%
25.12.2006	bis	31.12.2007	-1,4%	-3,5%	-16,9%
31.12.2007	bis	29.12.2008	3,6%	8,1%	-23,9%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-20,6%	-11,2%	68,5%
28.12.2009	bis	27.12.2010	-10,6%	-0,8%	3,4%
27.12.2010	bis	26.12.2011	13,3%	4,4%	-19,3%
26.12.2011	bis	31.12.2012	-10,0%	2,2%	9,0%
31.12.2012	bis	30.12.2013	-4,6%	3,9%	-11,3%
30.12.2013	bis	29.12.2014	14,7%	9,4%	-10,4%
29.12.2014	bis	28.12.2015	7,9%	8,4%	-9,2%
28.12.2015	bis	26.12.2016	0,1%	-7,8%	16,3%
26.12.2016	bis	25.12.2017	0,2%	5,6%	2,6%
25.12.2017	bis	31.12.2018	6,8%	6,3%	-4,4%
31.12.2018	bis	30.12.2019	5,3%	4,2%	2,5%
30.12.2019	bis	28.12.2020	8,9%	6,8%	9,8%
28.12.2020	bis	27.12.2021	5,1%	-1,0%	-9,1%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	1,0%	15,6%	12,3%	10,8%	12,0%	11,1%	8,8%	4,0%	0,3%	-0,8%	-17,3%
27.12.2004	bis	28.12.2009	6,6%	8,3%	9,3%	5,8%	6,4%	6,5%	6,9%	6,9%	9,7%	7,3%	0,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	8,8%	11,5%	13,9%	19,7%	17,6%	15,9%	15,7%	18,7%	16,3%	7,0%	-3,3%
29.12.2014	bis	30.12.2019	7,4%	10,1%	11,7%	11,1%	8,0%	9,8%	7,7%	12,0%	6,2%	11,3%	4,2%
30.12.2019	bis	27.12.2021	2,5%	7,9%	3,7%	7,7%	5,0%	6,5%	10,3%	10,3%	12,7%	5,2%	2,2%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	18,9%	9,8%	11,1%	12,1%	13,2%	14,8%	15,2%	16,6%	18,9%	23,4%	29,1%
27.12.2004	bis	28.12.2009	20,7%	15,0%	17,9%	18,4%	20,5%	22,6%	24,7%	27,2%	28,5%	30,3%	38,2%
28.12.2009	bis	29.12.2014	15,5%	10,3%	12,1%	13,1%	14,3%	15,5%	16,9%	19,0%	19,2%	21,6%	24,4%
29.12.2014	bis	30.12.2019	14,0%	10,4%	11,8%	12,6%	13,2%	14,8%	15,6%	15,5%	15,5%	16,4%	22,5%
30.12.2019	bis	27.12.2021	22,1%	19,8%	22,1%	21,4%	21,4%	24,7%	24,9%	26,5%	29,0%	32,8%	45,8%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	33,3%	22,2%	23,0%	27,3%	29,9%	28,3%	34,4%	40,2%	44,0%	50,8%	74,0%
27.12.2004	bis	28.12.2009	44,7%	31,4%	38,2%	43,5%	49,7%	52,3%	55,8%	58,8%	56,6%	64,7%	72,3%
28.12.2009	bis	29.12.2014	15,8%	11,2%	13,4%	14,4%	14,5%	15,6%	19,7%	21,6%	21,0%	27,0%	37,0%
29.12.2014	bis	30.12.2019	16,8%	9,5%	11,5%	14,3%	16,4%	19,3%	20,9%	20,0%	22,1%	21,3%	34,4%
30.12.2019	bis	27.12.2021	35,0%	31,1%	37,2%	36,0%	35,2%	36,3%	36,1%	38,1%	38,6%	46,6%	48,9%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	19,1%	19,2%	1,0%	11,4%	8,4%	18,9%	24,6%	14,4%	33,3%
27.12.2004	bis	28.12.2009	5,0%	7,1%	6,6%	16,2%	12,2%	20,7%	32,5%	20,9%	44,7%
28.12.2009	bis	29.12.2014	9,7%	7,8%	8,8%	8,3%	6,9%	15,5%	8,1%	5,8%	15,8%
29.12.2014	bis	30.12.2019	11,6%	9,6%	7,4%	8,4%	6,9%	14,0%	9,0%	7,2%	16,8%
30.12.2019	bis	27.12.2021	9,8%	9,3%	2,5%	18,1%	11,5%	22,1%	28,8%	18,0%	35,0%

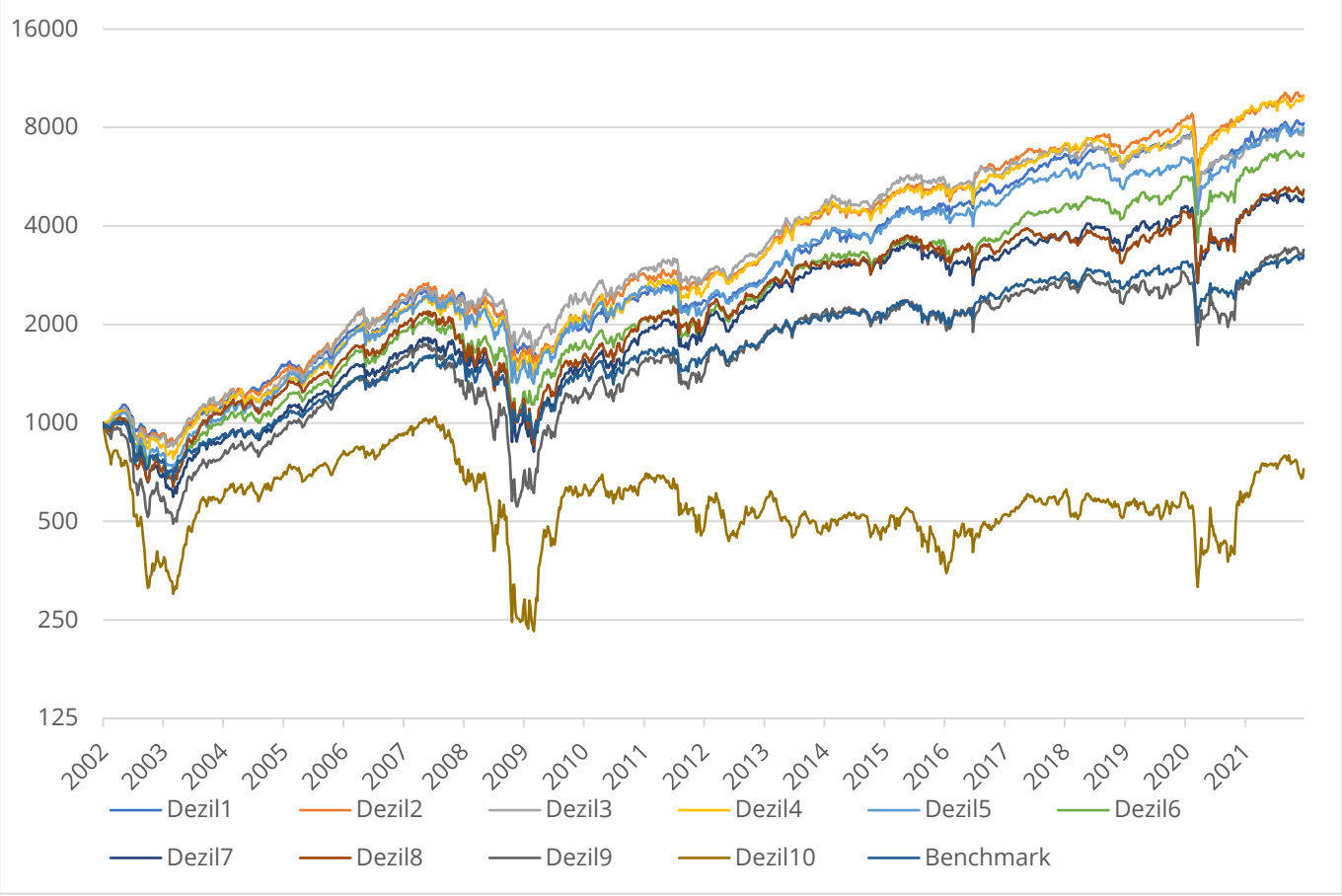
Technischer Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	England
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	FTSE350
Durchschnittliche Anzahl Aktien	340	Scoring-Modell:	Technischer Score

Dezilanalyse

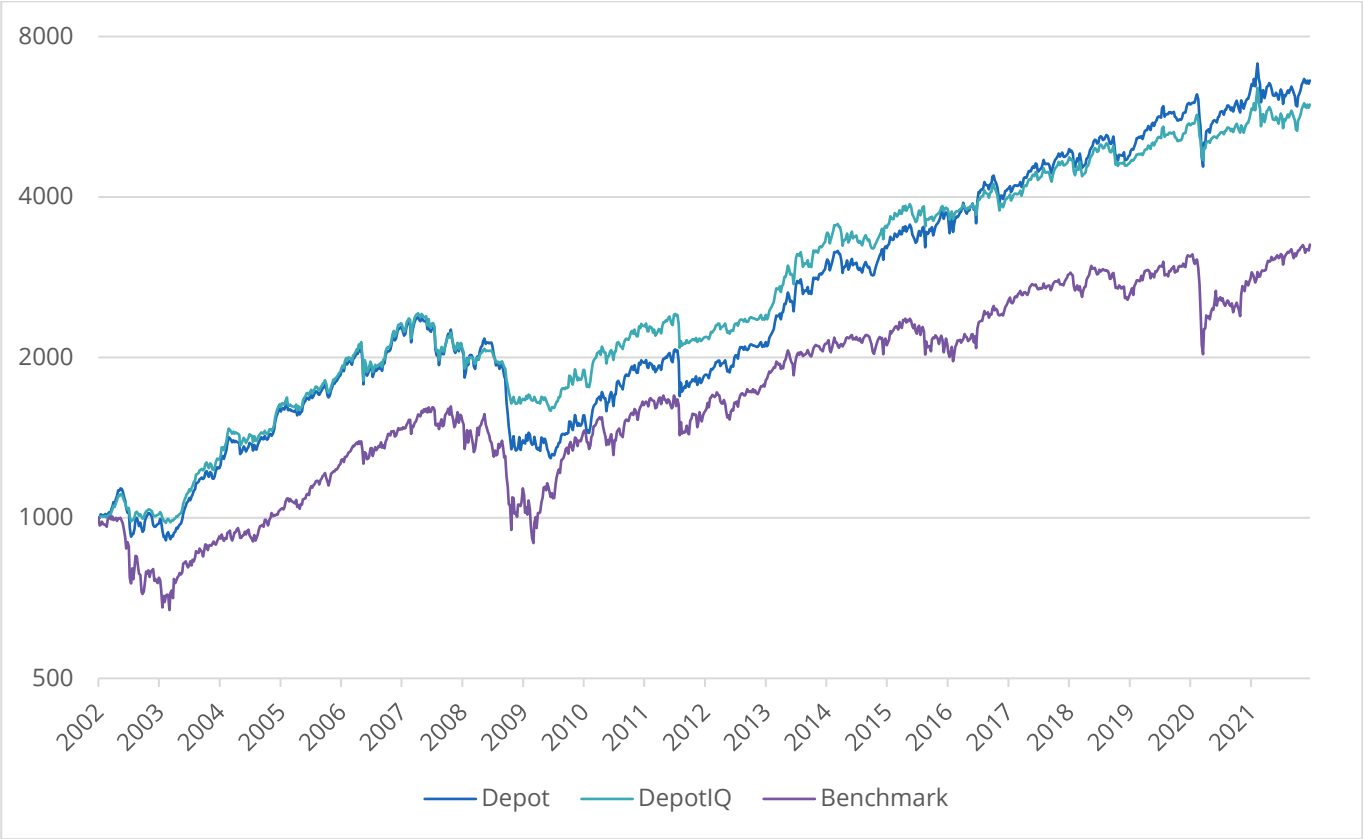
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	6,1%	11,1%	12,2%	10,8%	12,1%	10,9%	9,9%	8,2%	8,5%	6,3%	-1,6%
Annualisierte Volatilität	17,8%	15,1%	15,8%	16,9%	17,4%	17,5%	18,9%	20,2%	21,8%	23,5%	31,3%
Maximaler Drawdown	44,7%	38,5%	44,9%	37,7%	43,8%	46,5%	52,9%	55,2%	61,2%	68,3%	77,9%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,341	0,737	0,772	0,639	0,699	0,623	0,525	0,407	0,392	0,268	-0,051
Max 3 Jahre rollierend	98,9%	124,3%	141,2%	148,1%	139,4%	156,7%	149,9%	162,0%	171,7%	175,3%	173,2%
Min 3 Jahre rollierend	-33,7%	-22,0%	-28,5%	-21,7%	-25,1%	-29,1%	-30,1%	-45,0%	-49,8%	-54,8%	-72,1%
Max 5 Jahre rollierend	138,0%	171,6%	201,7%	197,1%	233,5%	209,1%	214,3%	274,8%	261,6%	287,9%	200,3%
Min 5 Jahre rollierend	-11,3%	-6,8%	2,7%	-11,5%	5,3%	-4,4%	-1,5%	-20,2%	-25,6%	-28,1%	-63,6%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	78,6%	81,1%	71,4%	76,6%	73,8%	77,8%	73,4%	68,6%	61,3%	31,9%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	9,9%	9,3%	6,1%
Annualisierte Volatilität	16,2%	13,2%	17,8%
Maximaler Drawdown	45,7%	34,5%	44,7%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,611	0,706	0,341
Max 3 Jahre rollierend	118,4%	110,5%	98,9%
Min 3 Jahre rollierend	-37,4%	-25,0%	-33,7%
Max 5 Jahre rollierend	147,3%	136,5%	138,0%
Min 5 Jahre rollierend	-20,9%	-6,9%	-11,3%
Anteil Outperformance 1 Jahr	65,7%	64,1%	---

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Technisch	70%
Verkaufskriterium 2	Technisch	70%
Depotumschlagsfaktor	1,49	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	21,9%	16,9%	-28,3%
30.12.2002	bis	29.12.2003	6,5%	3,5%	26,7%
29.12.2003	bis	27.12.2004	15,3%	14,6%	5,1%
27.12.2004	bis	26.12.2005	-6,2%	3,1%	4,1%
26.12.2005	bis	25.12.2006	6,6%	14,8%	3,0%
25.12.2006	bis	31.12.2007	-12,6%	-4,5%	-23,4%
31.12.2007	bis	29.12.2008	-4,2%	-0,2%	-28,5%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-22,7%	-11,4%	85,6%
28.12.2009	bis	27.12.2010	13,5%	15,3%	2,0%
27.12.2010	bis	26.12.2011	-0,9%	-0,1%	-14,7%
26.12.2011	bis	31.12.2012	1,3%	4,3%	11,2%
31.12.2012	bis	30.12.2013	19,4%	16,0%	-15,4%
30.12.2013	bis	29.12.2014	8,2%	7,2%	-3,5%
29.12.2014	bis	28.12.2015	15,7%	14,1%	-8,1%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-5,6%	-3,6%	4,6%
26.12.2016	bis	25.12.2017	4,1%	7,2%	2,5%
25.12.2017	bis	31.12.2018	7,7%	4,3%	-5,3%
31.12.2018	bis	30.12.2019	6,1%	3,6%	0,4%
30.12.2019	bis	28.12.2020	14,1%	8,8%	6,9%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-11,0%	-1,2%	4,4%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	1,0%	14,6%	12,6%	11,0%	9,2%	9,2%	4,7%	1,6%	7,7%	-2,3%	-12,1%
27.12.2004	bis	28.12.2009	6,6%	5,5%	8,0%	11,8%	9,9%	9,2%	8,4%	7,3%	4,5%	5,3%	-2,3%
28.12.2009	bis	29.12.2014	8,8%	15,5%	17,9%	15,8%	17,2%	14,5%	13,1%	15,9%	15,9%	12,1%	-4,5%
29.12.2014	bis	30.12.2019	7,4%	13,2%	11,9%	8,3%	11,8%	10,2%	12,1%	7,7%	6,2%	6,1%	5,0%
30.12.2019	bis	27.12.2021	2,5%	4,6%	9,0%	2,1%	10,9%	11,0%	8,5%	3,5%	7,8%	8,2%	8,5%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	18,9%	10,2%	11,1%	13,9%	15,3%	15,1%	16,1%	16,6%	17,5%	21,5%	27,6%
27.12.2004	bis	28.12.2009	20,7%	16,8%	19,3%	20,2%	21,5%	22,3%	23,3%	25,3%	28,4%	30,1%	39,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	15,5%	14,8%	14,6%	15,6%	16,0%	15,5%	16,2%	16,0%	17,4%	18,0%	24,1%
29.12.2014	bis	30.12.2019	14,0%	11,9%	12,0%	12,9%	12,6%	13,1%	14,4%	15,6%	16,5%	17,9%	23,6%
30.12.2019	bis	27.12.2021	22,1%	22,8%	22,2%	22,6%	22,3%	21,7%	25,9%	29,0%	29,0%	31,2%	43,1%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	33,3%	24,3%	21,6%	23,9%	28,8%	32,6%	37,7%	41,5%	38,7%	50,9%	70,0%
27.12.2004	bis	28.12.2009	44,7%	38,5%	44,9%	36,4%	43,8%	46,5%	52,9%	55,2%	61,2%	68,3%	77,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	15,8%	16,8%	14,9%	16,7%	15,5%	19,4%	19,8%	19,0%	16,9%	21,4%	37,8%
29.12.2014	bis	30.12.2019	16,8%	11,0%	12,6%	16,4%	16,6%	17,1%	19,5%	25,5%	24,5%	20,2%	37,0%
30.12.2019	bis	27.12.2021	35,0%	37,4%	35,7%	37,7%	34,4%	33,1%	37,1%	41,9%	39,2%	40,3%	48,6%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	16,8%	17,6%	1,0%	12,2%	9,3%	18,9%	20,2%	11,7%	33,3%
27.12.2004	bis	28.12.2009	-1,0%	2,5%	6,6%	18,2%	14,7%	20,7%	45,7%	34,5%	44,7%
28.12.2009	bis	29.12.2014	16,4%	13,9%	8,8%	15,7%	13,6%	15,5%	18,3%	13,7%	15,8%
29.12.2014	bis	30.12.2019	13,1%	9,2%	7,4%	14,4%	11,5%	14,0%	10,9%	10,9%	16,8%
30.12.2019	bis	27.12.2021	5,0%	4,2%	2,5%	21,0%	16,8%	22,1%	26,8%	17,8%	35,0%

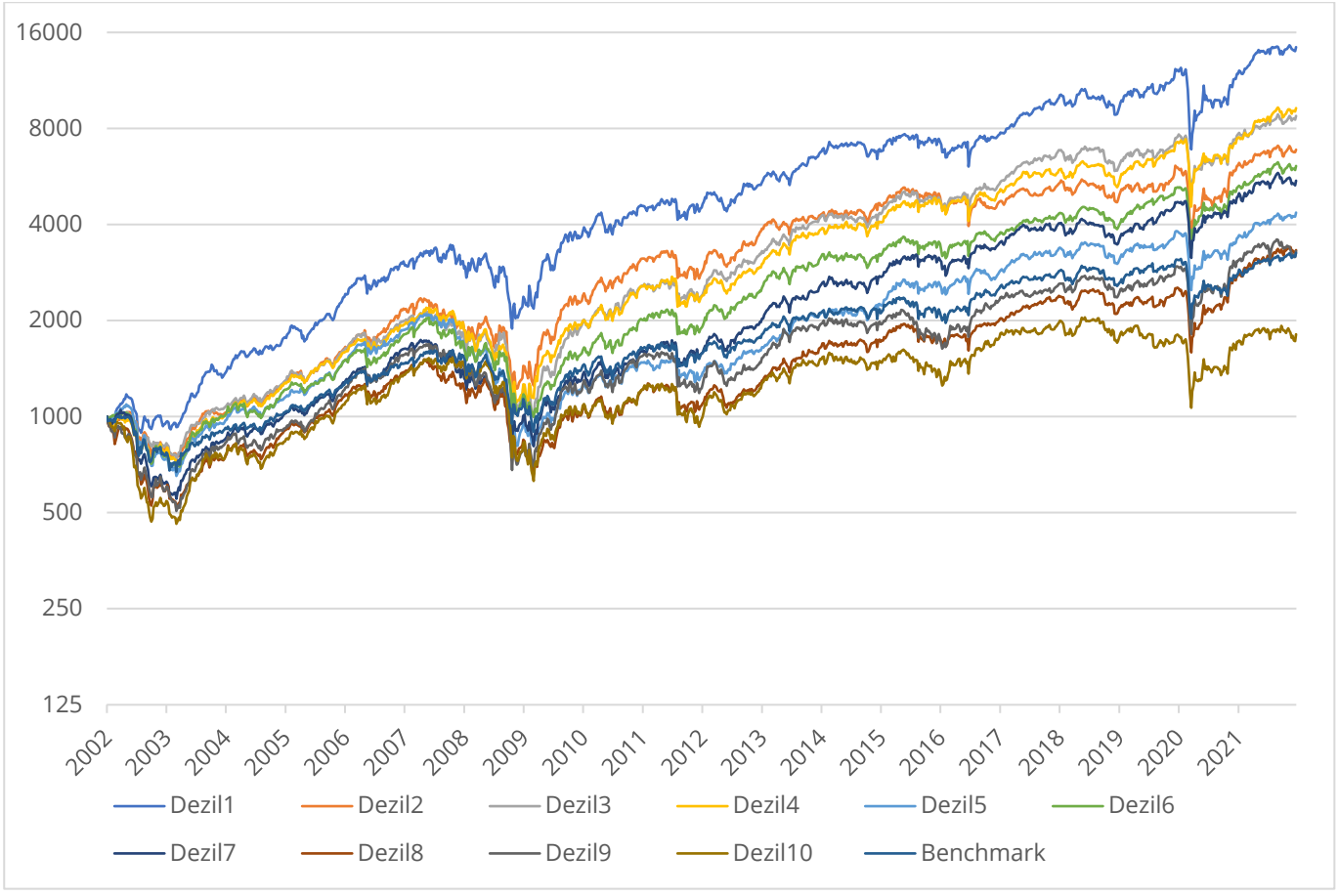
Value-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	England
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	FTSE350
Durchschnittliche Anzahl Aktien	327	Scoring-Modell:	Value-Score

Dezilanalyse

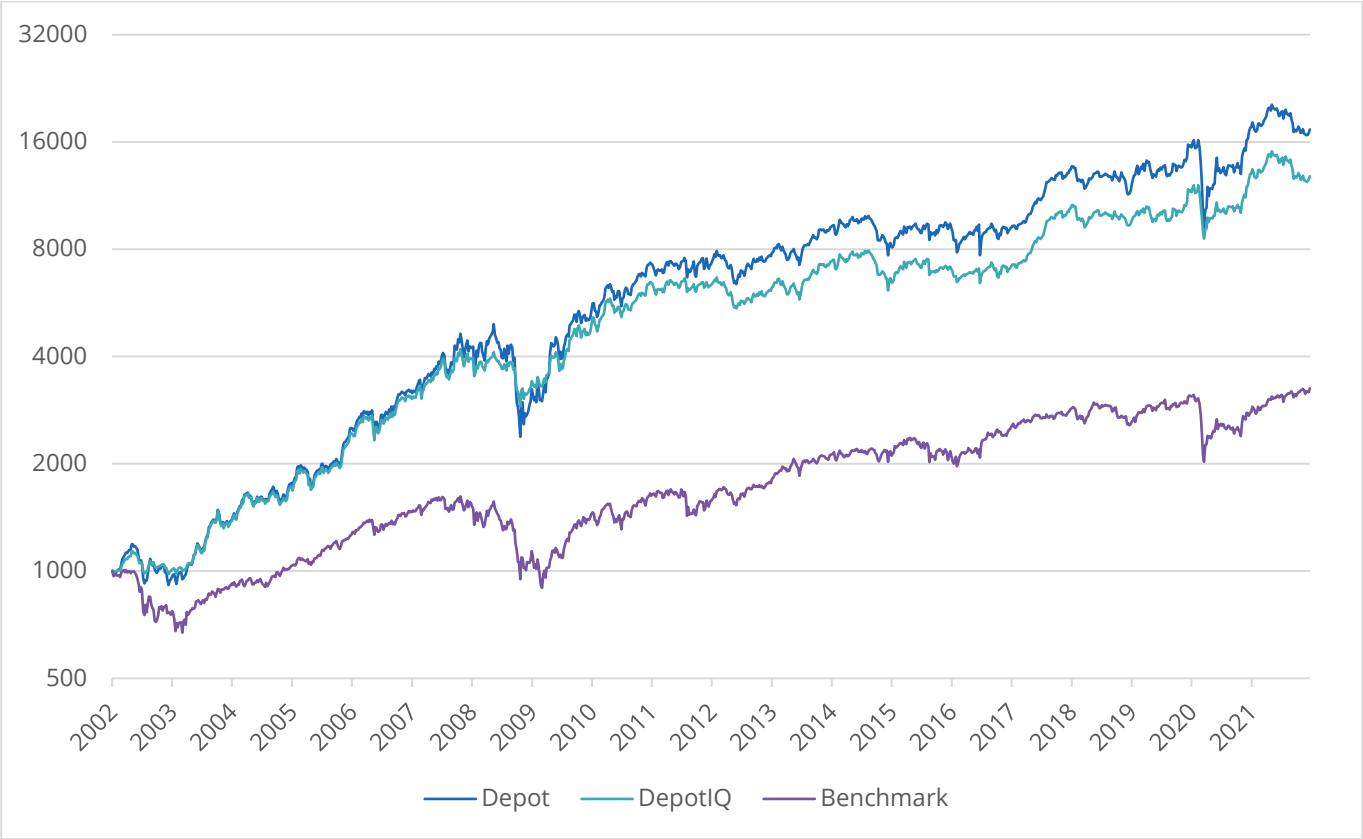
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	6,1%	14,2%	10,1%	11,4%	11,8%	7,6%	9,5%	8,9%	6,2%	6,2%	3,0%
Annualisierte Volatilität	17,8%	20,6%	19,9%	19,0%	18,7%	18,0%	17,9%	18,2%	19,0%	21,0%	21,3%
Maximaler Drawdown	44,7%	45,4%	49,5%	53,6%	49,8%	61,4%	51,1%	53,6%	56,4%	59,7%	59,0%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,341	0,690	0,506	0,602	0,629	0,424	0,527	0,487	0,326	0,293	0,141
Max 3 Jahre rollierend	98,9%	184,0%	159,5%	176,8%	149,9%	149,1%	131,1%	148,9%	141,3%	164,7%	158,1%
Min 3 Jahre rollierend	-33,7%	-16,6%	-28,9%	-43,2%	-33,2%	-50,2%	-37,0%	-41,1%	-45,9%	-47,2%	-46,9%
Max 5 Jahre rollierend	138,0%	272,4%	257,1%	332,2%	246,2%	187,3%	218,5%	235,0%	157,1%	187,6%	213,7%
Min 5 Jahre rollierend	-11,3%	-7,0%	-25,3%	-10,7%	2,7%	-34,3%	-7,0%	-10,7%	-26,4%	-24,4%	-32,3%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	81,1%	70,6%	80,7%	80,2%	66,1%	77,0%	75,0%	60,5%	57,7%	50,8%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	15,3%	13,6%	6,1%
Annualisierte Volatilität	23,7%	17,5%	17,8%
Maximaler Drawdown	51,7%	31,0%	44,7%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,646	0,774	0,341
Max 3 Jahre rollierend	208,1%	169,6%	98,9%
Min 3 Jahre rollierend	-5,6%	-8,2%	-33,7%
Max 5 Jahre rollierend	386,2%	315,3%	138,0%
Min 5 Jahre rollierend	1,8%	-1,0%	-11,3%
Anteil Outperformance 1 Jahr	74,2%	70,6%	---

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Value	90%
Verkaufskriterium 2	Value	90%
Depotumschlagsfaktor	0,75	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	19,2%	11,3%	-19,8%
30.12.2002	bis	29.12.2003	25,3%	16,0%	18,8%
29.12.2003	bis	27.12.2004	14,5%	14,0%	-0,3%
27.12.2004	bis	26.12.2005	20,7%	8,7%	9,1%
26.12.2005	bis	25.12.2006	10,3%	13,9%	9,2%
25.12.2006	bis	31.12.2007	27,1%	-9,7%	-3,1%
31.12.2007	bis	29.12.2008	1,2%	0,5%	-16,4%
29.12.2008	bis	28.12.2009	40,7%	38,5%	12,3%
28.12.2009	bis	27.12.2010	25,8%	13,6%	5,3%
27.12.2010	bis	26.12.2011	3,9%	-1,0%	-14,9%
26.12.2011	bis	31.12.2012	-7,2%	14,5%	11,0%
31.12.2012	bis	30.12.2013	0,5%	-0,7%	7,4%
30.12.2013	bis	29.12.2014	-12,0%	3,4%	-1,9%
29.12.2014	bis	28.12.2015	13,3%	7,5%	-7,2%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-19,0%	-17,4%	9,8%
26.12.2016	bis	25.12.2017	33,9%	9,0%	-0,9%
25.12.2017	bis	31.12.2018	-4,2%	-0,9%	-0,8%
31.12.2018	bis	30.12.2019	14,0%	10,7%	-5,7%
30.12.2019	bis	28.12.2020	22,4%	9,4%	9,8%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-18,3%	-0,1%	-10,7%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	1,0%	21,0%	8,4%	8,7%	8,2%	4,5%	6,5%	0,5%	-3,5%	-2,9%	-5,9%
27.12.2004	bis	28.12.2009	6,6%	15,8%	12,6%	8,5%	9,1%	1,5%	5,5%	5,3%	2,6%	5,7%	4,6%
28.12.2009	bis	29.12.2014	8,8%	13,3%	15,0%	17,5%	15,8%	13,0%	15,4%	15,9%	11,2%	10,4%	7,5%
29.12.2014	bis	30.12.2019	7,4%	12,1%	5,3%	11,6%	12,2%	11,0%	10,1%	11,3%	7,8%	8,3%	3,8%
30.12.2019	bis	27.12.2021	2,5%	8,6%	6,7%	7,8%	13,1%	7,0%	8,0%	7,9%	14,5%	5,7%	0,1%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	18,9%	14,4%	13,7%	13,5%	14,8%	15,9%	16,7%	17,4%	20,1%	19,7%	21,0%
27.12.2004	bis	28.12.2009	20,7%	26,2%	25,8%	26,0%	22,8%	23,0%	21,0%	22,0%	22,3%	25,8%	25,0%
28.12.2009	bis	29.12.2014	15,5%	16,2%	16,3%	15,6%	16,4%	15,3%	15,7%	16,5%	16,3%	17,9%	18,6%
29.12.2014	bis	30.12.2019	14,0%	16,3%	15,9%	13,9%	14,3%	13,5%	13,0%	13,3%	13,4%	15,0%	16,4%
30.12.2019	bis	27.12.2021	22,1%	30,6%	27,1%	23,7%	26,5%	22,4%	25,8%	23,3%	25,4%	28,4%	28,3%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	33,3%	24,1%	29,2%	28,8%	31,9%	40,3%	33,2%	47,3%	48,9%	49,4%	53,9%
27.12.2004	bis	28.12.2009	44,7%	45,4%	49,5%	53,6%	49,8%	61,4%	51,1%	53,6%	56,4%	59,7%	59,0%
28.12.2009	bis	29.12.2014	15,8%	14,7%	18,4%	15,3%	19,5%	17,5%	16,3%	17,2%	18,8%	25,6%	26,8%
29.12.2014	bis	30.12.2019	16,8%	21,0%	24,3%	16,2%	17,1%	14,3%	14,7%	16,8%	17,4%	24,5%	22,9%
30.12.2019	bis	27.12.2021	35,0%	44,5%	39,8%	35,6%	38,6%	34,6%	35,9%	33,8%	37,3%	38,8%	41,1%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	20,9%	20,0%	1,0%	17,9%	13,9%	18,9%	23,3%	13,7%	33,3%
27.12.2004	bis	28.12.2009	23,9%	22,2%	6,6%	31,4%	22,0%	20,7%	51,7%	31,0%	44,7%
28.12.2009	bis	29.12.2014	10,0%	7,1%	8,8%	18,1%	15,4%	15,5%	22,5%	22,8%	15,8%
29.12.2014	bis	30.12.2019	13,4%	11,9%	7,4%	18,6%	14,5%	14,0%	19,2%	14,6%	16,8%
30.12.2019	bis	27.12.2021	5,3%	4,7%	2,5%	31,6%	21,7%	22,1%	43,2%	29,2%	35,0%

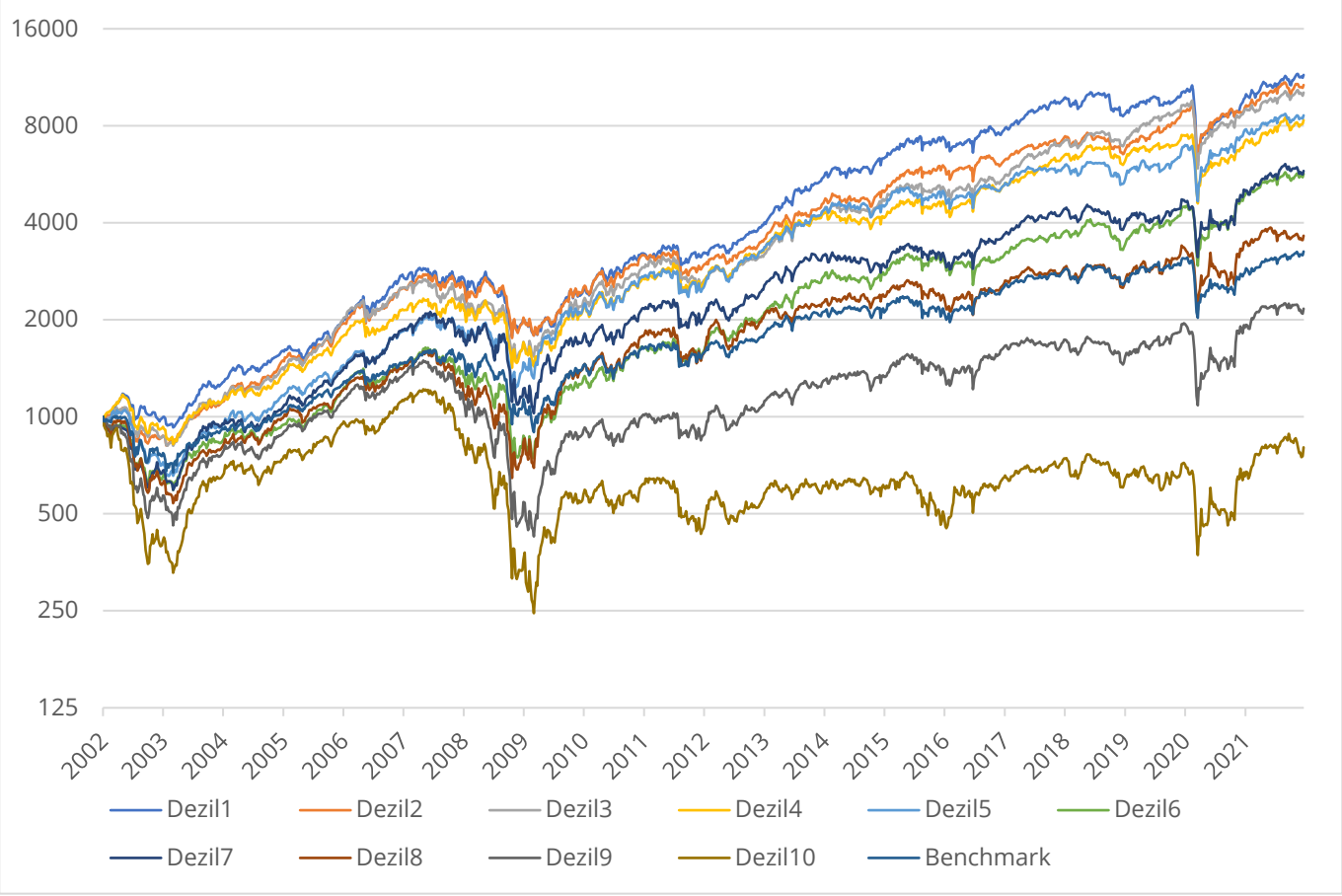
Kombi-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	England
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	FTSE350
Durchschnittliche Anzahl Aktien	327	Scoring-Modell:	Kombi-Score

Dezilanalyse

	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	6,1%	13,0%	12,6%	12,3%	11,2%	11,4%	9,1%	9,2%	6,7%	3,9%	-1,1%
Annualisierte Volatilität	17,8%	16,8%	15,7%	16,5%	17,0%	18,0%	19,3%	20,2%	21,9%	23,5%	28,5%
Maximaler Drawdown	44,7%	43,6%	36,6%	44,6%	39,1%	43,9%	55,3%	51,5%	59,7%	71,5%	79,8%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,341	0,772	0,800	0,741	0,658	0,632	0,468	0,454	0,305	0,167	-0,038
Max 3 Jahre rollierend	98,9%	133,5%	158,4%	167,4%	134,3%	136,9%	146,5%	155,2%	178,4%	164,7%	194,7%
Min 3 Jahre rollierend	-33,7%	-25,7%	-18,6%	-28,7%	-25,8%	-16,9%	-44,7%	-32,6%	-46,5%	-65,2%	-74,4%
Max 5 Jahre rollierend	138,0%	229,9%	227,2%	194,6%	199,7%	263,4%	282,1%	236,0%	246,9%	208,9%	211,5%
Min 5 Jahre rollierend	-11,3%	-11,2%	8,4%	2,3%	2,2%	-5,9%	-18,8%	-3,5%	-19,1%	-47,2%	-64,4%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	74,2%	77,4%	81,1%	83,9%	77,4%	69,4%	66,5%	58,1%	54,0%	33,5%

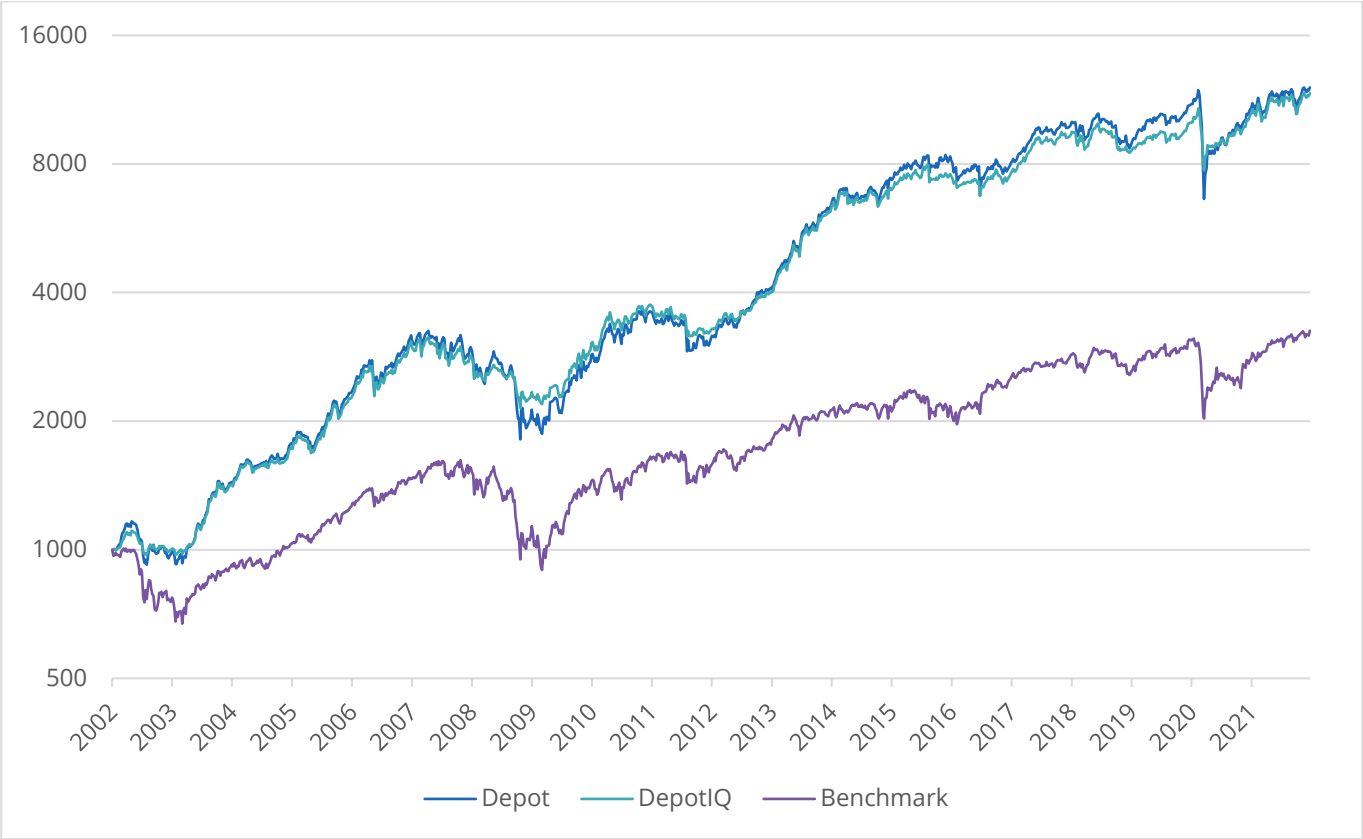


Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	13,2%	13,1%	6,1%
Annualisierte Volatilität	19,0%	14,5%	17,8%
Maximaler Drawdown	44,3%	31,7%	44,7%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,697	0,898	0,341

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Kombi	70%
Verkaufskriterium 2	Kombi	70%
Depotumschlagsfaktor	1,05	

Max 3 Jahre rollierend	183,8%	164,3%	98,9%
Min 3 Jahre rollierend	-28,5%	-15,5%	-33,7%
Max 5 Jahre rollierend	273,5%	211,4%	138,0%
Min 5 Jahre rollierend	-15,6%	3,8%	-11,3%
Anteil Outperformance 1 Jahr	71,0%	65,7%	---



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	22,0%	17,3%	-28,1%
30.12.2002	bis	29.12.2003	26,2%	7,4%	30,4%
29.12.2003	bis	27.12.2004	10,5%	16,8%	1,5%
27.12.2004	bis	26.12.2005	9,6%	4,9%	5,9%
26.12.2005	bis	25.12.2006	17,5%	17,5%	1,8%
25.12.2006	bis	31.12.2007	-10,8%	-4,3%	-22,3%
31.12.2007	bis	29.12.2008	-0,9%	4,6%	-29,1%
29.12.2008	bis	28.12.2009	3,4%	-8,0%	39,5%
28.12.2009	bis	27.12.2010	15,0%	14,9%	-3,5%
27.12.2010	bis	26.12.2011	-9,6%	1,1%	-14,9%
26.12.2011	bis	31.12.2012	19,8%	8,6%	11,5%
31.12.2012	bis	30.12.2013	35,0%	15,7%	-5,7%
30.12.2013	bis	29.12.2014	15,2%	9,9%	0,1%
29.12.2014	bis	28.12.2015	12,3%	18,1%	-6,2%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-20,2%	-12,2%	5,6%
26.12.2016	bis	25.12.2017	10,4%	8,7%	-3,4%
25.12.2017	bis	31.12.2018	-1,6%	-1,5%	-6,6%
31.12.2018	bis	30.12.2019	5,1%	7,2%	5,0%
30.12.2019	bis	28.12.2020	7,9%	7,7%	6,3%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-4,6%	2,3%	-1,2%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002 bis 27.12.2004	1,0%	17,0%	14,1%	12,2%	10,4%	5,1%	-2,1%	1,9%	-0,4%	-4,2%	-9,8%
27.12.2004 bis 28.12.2009	6,6%	8,7%	10,5%	9,5%	9,5%	13,0%	6,4%	10,2%	7,2%	0,1%	-5,6%
28.12.2009 bis 29.12.2014	8,8%	21,1%	15,5%	16,4%	14,5%	16,1%	17,0%	11,6%	11,3%	8,8%	2,2%
29.12.2014 bis 30.12.2019	7,4%	10,0%	12,0%	14,3%	12,3%	8,6%	9,8%	9,5%	6,9%	7,7%	3,2%
30.12.2019 bis 27.12.2021	2,5%	6,0%	9,8%	4,6%	5,5%	12,0%	12,4%	11,0%	4,2%	5,3%	5,7%

Annualisierte Volatilität	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002 bis 27.12.2004	18,9%	11,7%	12,0%	12,5%	13,5%	15,8%	16,3%	17,1%	18,6%	22,3%	27,7%
27.12.2004 bis 28.12.2009	20,7%	19,5%	19,2%	20,5%	20,7%	22,1%	25,1%	25,3%	28,5%	30,6%	35,7%
28.12.2009 bis 29.12.2014	15,5%	14,6%	14,7%	14,9%	15,7%	16,3%	16,4%	17,9%	18,8%	17,1%	20,7%
29.12.2014 bis 30.12.2019	14,0%	13,5%	12,2%	12,6%	12,4%	13,6%	14,7%	15,2%	15,1%	16,2%	21,7%
30.12.2019 bis 27.12.2021	22,1%	26,3%	20,7%	22,5%	23,5%	22,6%	23,7%	26,3%	28,7%	32,6%	39,8%

Maximaler Drawdown	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002 bis 27.12.2004	33,3%	21,6%	23,6%	24,1%	29,9%	37,7%	40,7%	40,7%	46,1%	53,9%	67,2%
27.12.2004 bis 28.12.2009	44,7%	38,7%	36,6%	44,6%	39,1%	43,9%	55,3%	51,5%	59,7%	71,5%	79,8%
28.12.2009 bis 29.12.2014	15,8%	14,8%	16,1%	18,8%	17,5%	18,0%	15,8%	18,3%	22,5%	17,8%	32,9%
29.12.2014 bis 30.12.2019	16,8%	15,8%	14,2%	13,0%	13,0%	15,2%	19,8%	16,8%	22,0%	22,1%	33,0%
30.12.2019 bis 27.12.2021	35,0%	43,6%	33,0%	38,4%	38,9%	33,2%	34,9%	33,5%	36,2%	44,4%	48,2%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum	Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002 bis 27.12.2004	21,0%	20,1%	1,0%	14,4%	10,7%	18,9%	20,8%	12,5%	33,3%
27.12.2004 bis 28.12.2009	9,2%	11,1%	6,6%	22,9%	17,5%	20,7%	44,3%	31,7%	44,7%
28.12.2009 bis 29.12.2014	21,9%	19,1%	8,8%	16,1%	13,9%	15,5%	19,7%	15,8%	15,8%
29.12.2014 bis 30.12.2019	8,2%	7,2%	7,4%	15,0%	11,8%	14,0%	19,6%	15,0%	16,8%
30.12.2019 bis 27.12.2021	4,8%	8,3%	2,5%	28,1%	18,7%	22,1%	44,3%	28,5%	35,0%

Niederlande + Belgien – AEX AllShare & Bel20, BelMid, BelSmall

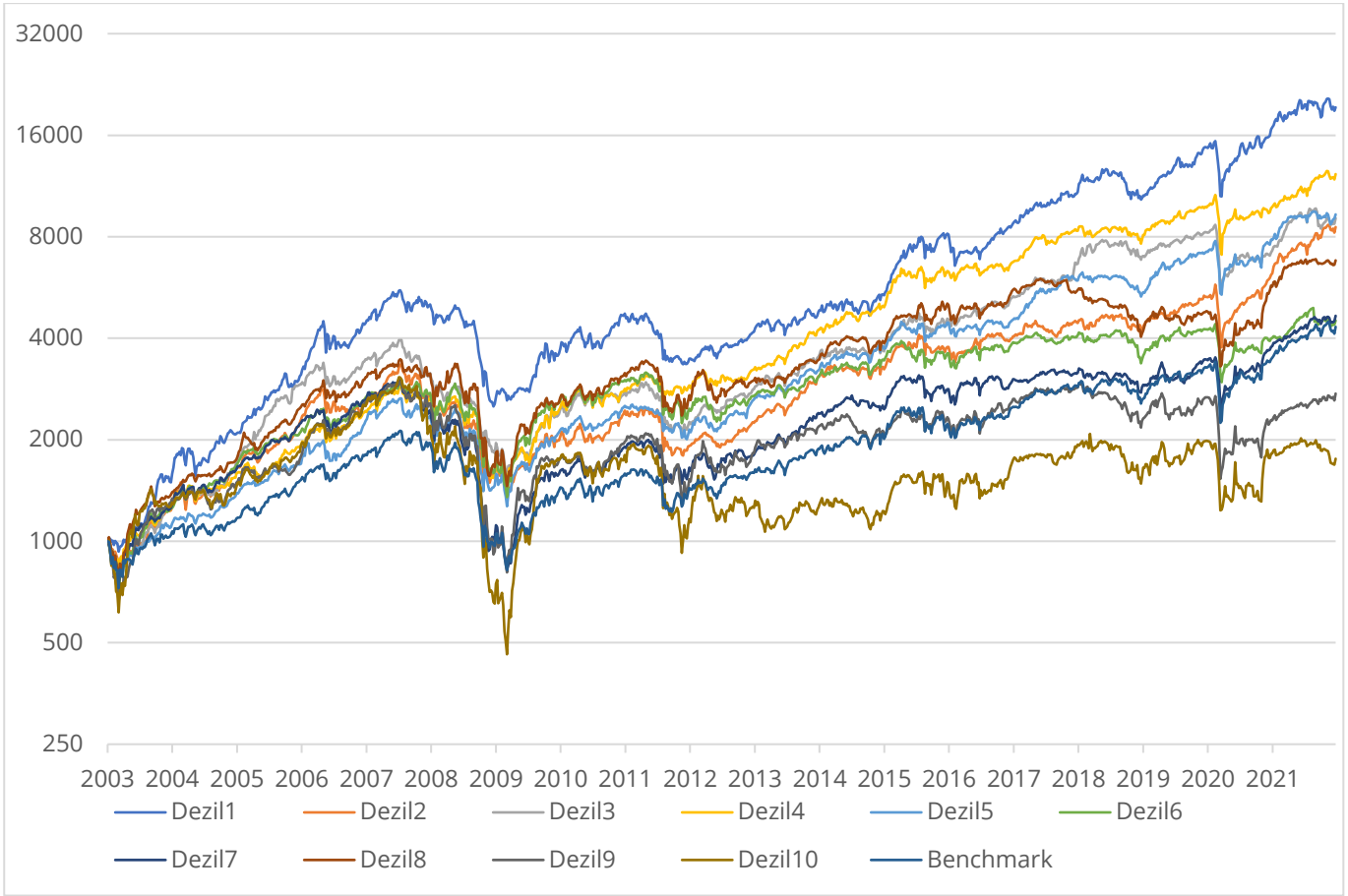
Trend-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	06.01.2003	Region:	Niederlande + Belgien
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	AEX AllShare
Durchschnittliche Anzahl Aktien	122	Scoring-Modell:	Trend-Score

Dezilanalyse

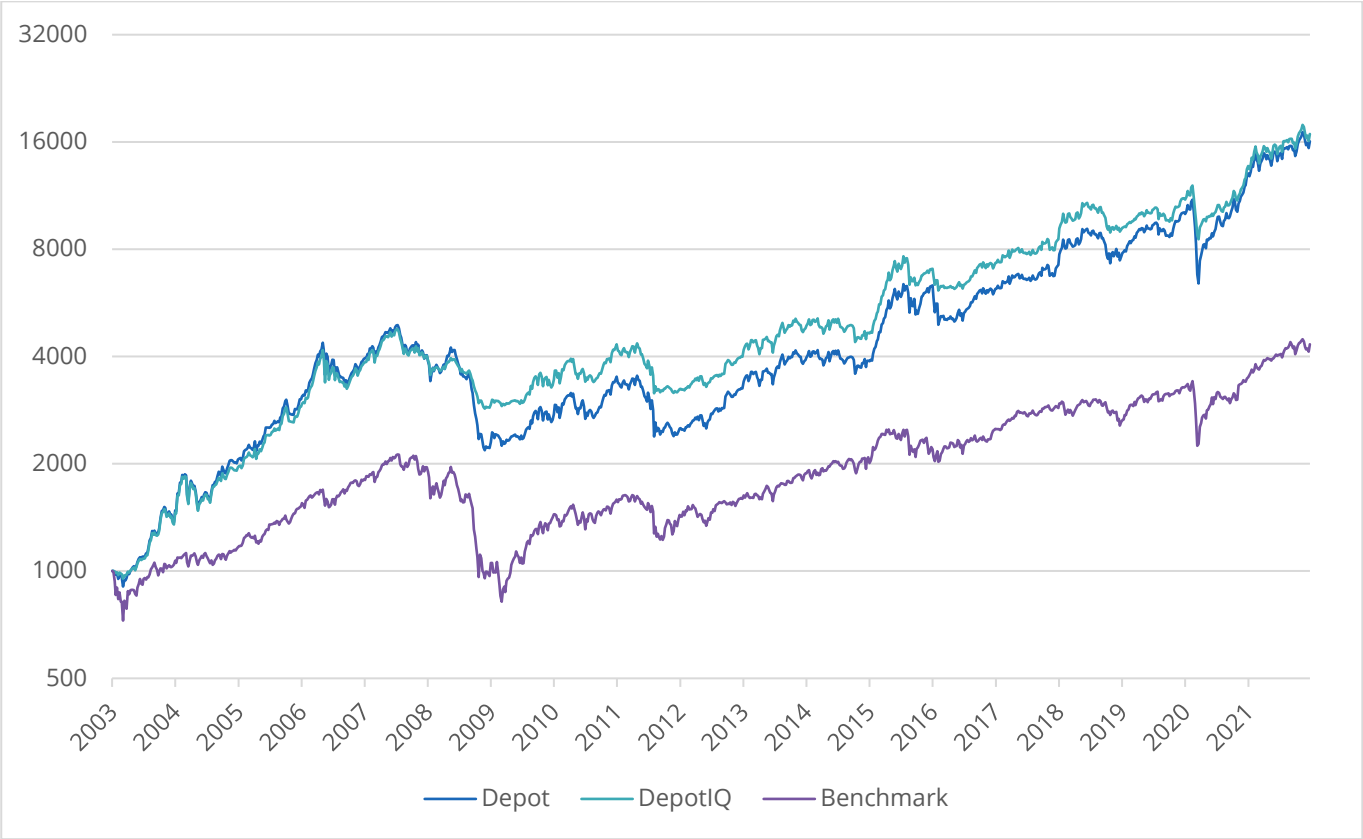
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	8,0%	16,8%	11,9%	12,3%	14,1%	12,4%	8,2%	8,4%	10,6%	5,4%	3,0%
Annualisierte Volatilität	20,1%	20,1%	18,5%	17,6%	17,7%	17,2%	19,6%	19,9%	21,4%	24,0%	30,6%
Maximaler Drawdown	61,4%	54,8%	58,5%	61,1%	50,4%	52,2%	55,3%	72,6%	57,9%	72,8%	84,9%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,398	0,837	0,645	0,698	0,797	0,724	0,420	0,423	0,495	0,226	0,098
Max 3 Jahre rollierend	121,1%	326,6%	208,2%	282,2%	162,5%	144,2%	244,3%	206,6%	271,7%	216,6%	247,8%
Min 3 Jahre rollierend	-49,2%	-38,2%	-47,0%	-51,9%	-31,3%	-32,2%	-42,2%	-65,0%	-47,7%	-61,6%	-78,7%
Max 5 Jahre rollierend	134,4%	403,5%	192,6%	235,2%	210,4%	187,9%	274,3%	195,8%	288,6%	243,9%	215,9%
Min 5 Jahre rollierend	-34,4%	-34,6%	-42,5%	-37,4%	4,6%	-18,4%	-22,7%	-47,9%	-28,1%	-46,3%	-66,1%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	72,8%	65,5%	57,0%	75,3%	72,8%	42,1%	47,2%	60,0%	39,2%	37,5%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	15,7%	16,0%	8,0%
Annualisierte Volatilität	22,9%	19,5%	20,1%
Maximaler Drawdown	55,4%	40,2%	61,4%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,685	0,819	0,398
Max 3 Jahre rollierend	324,4%	307,8%	121,1%
Min 3 Jahre rollierend	-45,5%	-28,7%	-49,2%
Max 5 Jahre rollierend	312,1%	301,9%	134,4%
Min 5 Jahre rollierend	-46,1%	-28,0%	-34,4%
Anteil Outperformance 1 Jahr	64,3%	65,5%	---

Anzahl Aktien im Depot	8	
Verkaufskriterium 1	Trend	70%
Verkaufskriterium 2	Trend	70%
Depotumschlagsfaktor	1,86	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
06.01.2003	bis	29.12.2003	32,7%	32,3%	24,5%
29.12.2003	bis	27.12.2004	36,0%	24,6%	1,3%
27.12.2004	bis	26.12.2005	19,9%	12,3%	-6,5%
26.12.2005	bis	25.12.2006	9,5%	8,6%	23,5%
25.12.2006	bis	31.12.2007	-5,2%	2,3%	-15,7%
31.12.2007	bis	29.12.2008	5,4%	4,7%	-16,4%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-26,0%	-12,0%	80,2%
28.12.2009	bis	27.12.2010	18,5%	14,1%	-5,0%
27.12.2010	bis	26.12.2011	-17,6%	-12,9%	-20,0%
26.12.2011	bis	31.12.2012	18,0%	6,0%	5,4%
31.12.2012	bis	30.12.2013	2,3%	8,3%	-7,8%
30.12.2013	bis	29.12.2014	-11,5%	-1,3%	-13,4%
29.12.2014	bis	28.12.2015	55,2%	26,1%	8,8%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-15,3%	-5,7%	0,9%
26.12.2016	bis	25.12.2017	1,8%	1,8%	-5,4%
25.12.2017	bis	31.12.2018	15,7%	5,1%	-10,1%
31.12.2018	bis	30.12.2019	8,2%	8,7%	-2,0%
30.12.2019	bis	28.12.2020	20,4%	8,5%	-17,4%
28.12.2020	bis	27.12.2021	0,7%	2,8%	-16,5%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003	bis	27.12.2004	7,5%	44,5%	28,0%	29,9%	24,5%	16,8%	29,1%	27,5%	32,1%	21,3%	19,2%
27.12.2004	bis	28.12.2009	4,1%	11,6%	4,1%	7,2%	9,7%	9,1%	9,2%	-0,4%	8,3%	3,5%	4,2%
28.12.2009	bis	29.12.2014	8,1%	8,4%	10,5%	9,2%	15,3%	12,5%	6,0%	9,8%	8,7%	4,1%	-6,7%
29.12.2014	bis	30.12.2019	9,4%	22,2%	10,0%	17,3%	14,3%	13,7%	4,2%	6,5%	4,2%	4,7%	10,0%
30.12.2019	bis	27.12.2021	15,0%	14,6%	26,9%	5,0%	12,0%	13,5%	3,0%	16,1%	18,8%	1,3%	-5,9%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003	bis	27.12.2004	23,8%	20,6%	19,3%	14,5%	18,4%	14,3%	22,7%	17,6%	24,4%	23,5%	31,4%
27.12.2004	bis	28.12.2009	23,5%	23,2%	21,7%	21,0%	21,5%	22,8%	24,3%	26,0%	27,4%	30,3%	38,4%
28.12.2009	bis	29.12.2014	17,4%	17,5%	16,7%	15,7%	15,0%	13,5%	17,5%	17,5%	18,5%	20,7%	27,3%
29.12.2014	bis	30.12.2019	15,7%	17,0%	13,9%	13,8%	13,1%	12,2%	13,8%	14,7%	14,0%	16,8%	22,7%
30.12.2019	bis	27.12.2021	23,2%	24,4%	23,0%	23,4%	22,2%	22,1%	20,8%	21,7%	23,5%	30,0%	33,2%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003	bis	27.12.2004	27,4%	17,4%	17,2%	16,9%	19,3%	24,1%	32,2%	24,2%	28,2%	33,4%	38,9%
27.12.2004	bis	28.12.2009	61,4%	54,8%	58,5%	61,1%	50,4%	52,2%	55,3%	72,6%	57,9%	72,8%	84,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	25,2%	29,3%	27,3%	29,1%	18,4%	21,0%	29,4%	25,8%	31,4%	38,6%	52,6%
29.12.2014	bis	30.12.2019	18,8%	19,9%	17,5%	13,5%	13,4%	15,2%	20,2%	18,1%	32,8%	25,9%	28,8%
30.12.2019	bis	27.12.2021	34,1%	31,6%	34,8%	36,9%	33,4%	30,8%	32,7%	30,7%	31,6%	43,2%	37,9%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
06.01.2003	bis	27.12.2004	42,2%	38,7%	7,5%	23,8%	22,7%	23,8%	20,1%	20,1%	27,4%
27.12.2004	bis	28.12.2009	5,7%	11,6%	4,1%	23,2%	20,0%	23,5%	55,4%	40,2%	61,4%
28.12.2009	bis	29.12.2014	7,9%	7,0%	8,1%	20,6%	18,1%	17,4%	32,4%	27,6%	25,2%
29.12.2014	bis	30.12.2019	21,0%	18,9%	9,4%	21,3%	17,6%	15,7%	23,1%	19,8%	18,8%
30.12.2019	bis	27.12.2021	25,9%	23,1%	15,0%	29,7%	22,7%	23,2%	41,8%	29,4%	34,1%

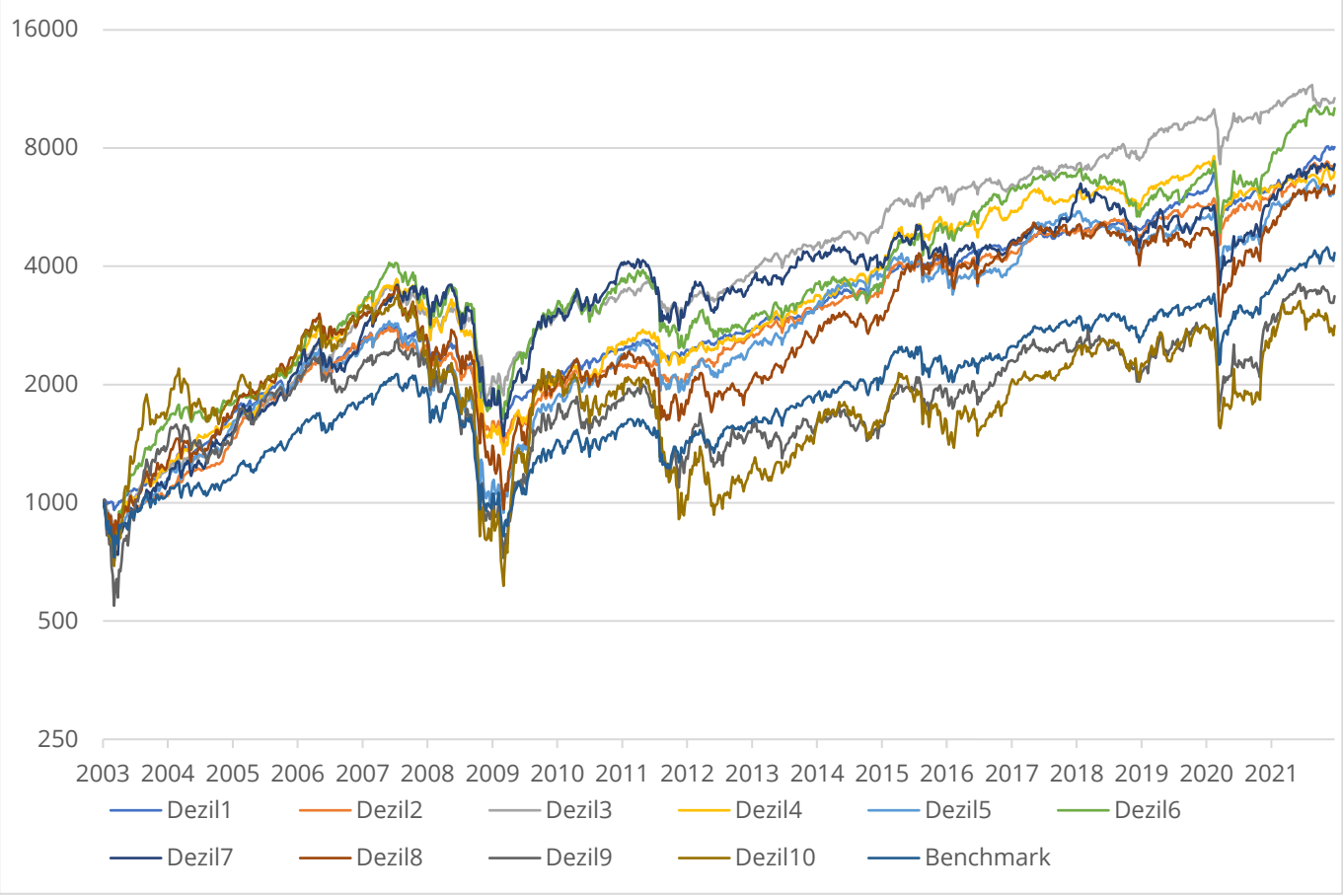
Safety-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	06.01.2003	Region:	Niederlande + Belgien
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	AEX AllShare
Durchschnittliche Anzahl Aktien	122	Scoring-Modell:	Safety-Score

Dezilanalyse

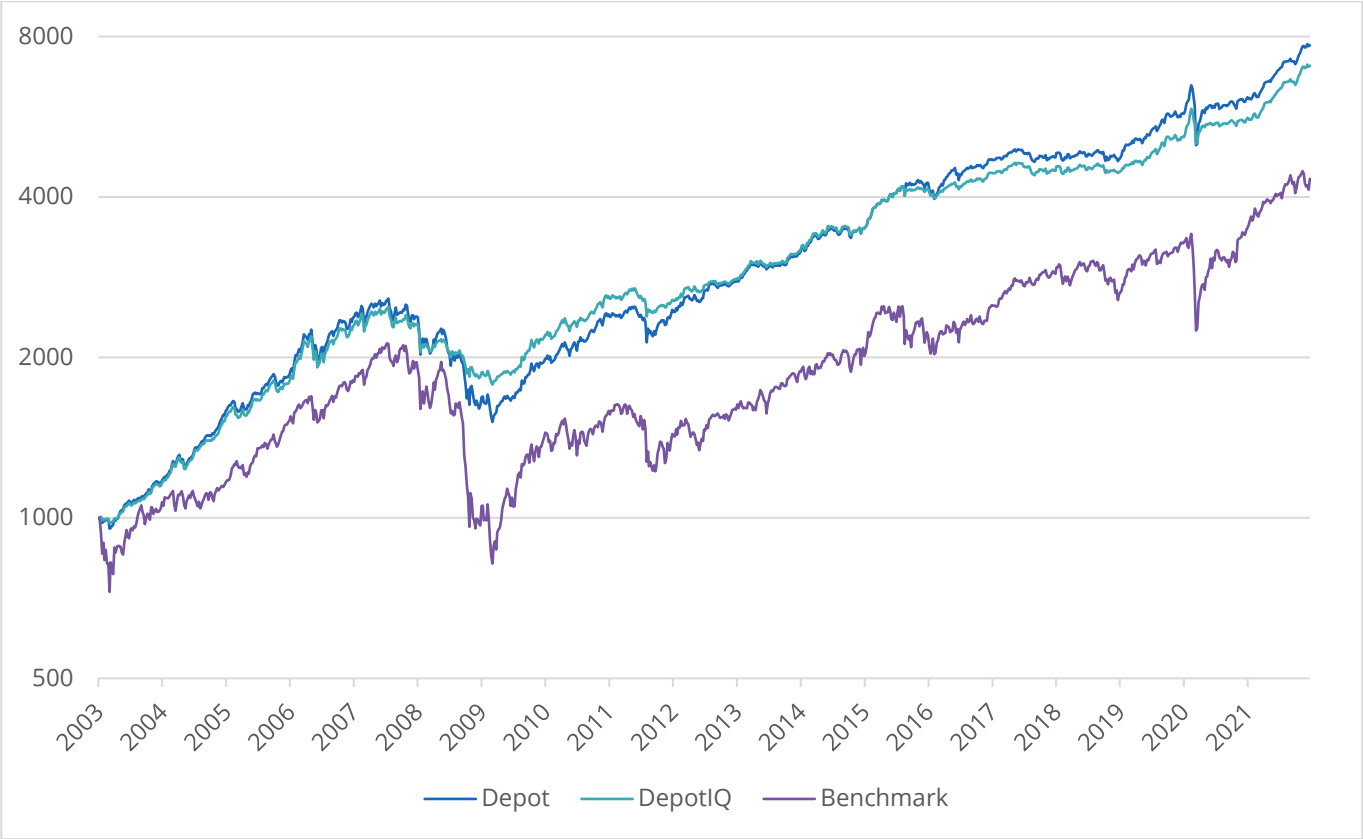
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	8,0%	11,6%	11,0%	13,3%	10,7%	10,2%	12,9%	11,0%	10,3%	6,6%	5,6%
Annualisierte Volatilität	20,1%	11,7%	13,7%	15,8%	16,9%	19,5%	20,6%	21,5%	24,3%	27,3%	32,6%
Maximaler Drawdown	61,4%	42,1%	49,9%	49,9%	64,3%	67,5%	59,8%	58,8%	72,9%	72,4%	81,9%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,398	0,988	0,798	0,840	0,633	0,525	0,626	0,510	0,423	0,241	0,172
Max 3 Jahre rollierend	121,1%	143,2%	160,5%	203,1%	218,4%	216,3%	240,3%	230,2%	245,2%	305,9%	289,6%
Min 3 Jahre rollierend	-49,2%	-30,1%	-35,7%	-21,1%	-49,1%	-58,8%	-38,6%	-36,9%	-64,7%	-67,8%	-76,8%
Max 5 Jahre rollierend	134,4%	161,2%	173,5%	271,4%	257,9%	258,6%	299,2%	365,6%	204,5%	268,6%	226,6%
Min 5 Jahre rollierend	-34,4%	-10,0%	-20,9%	-6,7%	-31,1%	-26,1%	-34,2%	-23,8%	-49,0%	-50,5%	-70,5%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	56,6%	62,6%	73,6%	64,3%	51,9%	60,9%	58,3%	48,5%	40,0%	47,2%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	11,3%	10,8%	8,0%
Annualisierte Volatilität	11,6%	8,8%	20,1%
Maximaler Drawdown	41,4%	28,6%	61,4%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,976	1,225	0,398
Max 3 Jahre rollierend	127,5%	117,8%	121,1%
Min 3 Jahre rollierend	-29,1%	-15,7%	-49,2%
Max 5 Jahre rollierend	138,9%	131,1%	134,4%
Min 5 Jahre rollierend	-2,8%	7,1%	-34,4%
Anteil Outperformance 1 Jahr	55,7%	51,5%	---

Anzahl Aktien im Depot	8	
Verkaufskriterium 1	Safety	80%
Verkaufskriterium 2	Safety	80%
Depotumschlagsfaktor	0,67	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
06.01.2003	bis	29.12.2003	11,9%	8,2%	47,7%
29.12.2003	bis	27.12.2004	23,5%	26,3%	-4,3%
27.12.2004	bis	26.12.2005	-13,1%	0,4%	4,4%
26.12.2005	bis	25.12.2006	8,3%	7,7%	1,0%
25.12.2006	bis	31.12.2007	-6,8%	-8,3%	-16,4%
31.12.2007	bis	29.12.2008	18,6%	15,0%	-13,3%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-25,0%	-23,2%	68,4%
28.12.2009	bis	27.12.2010	10,9%	5,1%	-6,7%
27.12.2010	bis	26.12.2011	11,5%	6,4%	-28,5%
26.12.2011	bis	31.12.2012	0,8%	6,9%	4,7%
31.12.2012	bis	30.12.2013	-4,8%	-2,5%	-0,9%
30.12.2013	bis	29.12.2014	0,7%	1,8%	-8,5%
29.12.2014	bis	28.12.2015	14,8%	10,2%	5,8%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-1,1%	-4,3%	7,4%
26.12.2016	bis	25.12.2017	-15,0%	-5,0%	-2,3%
25.12.2017	bis	31.12.2018	8,3%	8,8%	-2,6%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-3,0%	-3,5%	7,7%
30.12.2019	bis	28.12.2020	0,4%	-2,0%	-9,4%
28.12.2020	bis	27.12.2021	1,4%	-0,8%	-11,8%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003 bis 27.12.2004	7,5%	28,9%	19,7%	22,9%	26,4%	25,1%	33,7%	22,4%	28,6%	19,2%	35,5%
27.12.2004 bis 28.12.2009	4,1%	4,7%	6,5%	14,6%	5,4%	3,3%	11,8%	14,8%	3,7%	2,9%	2,0%
28.12.2009 bis 29.12.2014	8,1%	11,4%	11,9%	11,1%	13,9%	15,7%	3,1%	6,5%	8,6%	-0,7%	-4,2%
29.12.2014 bis 30.12.2019	9,4%	11,6%	10,3%	13,3%	12,8%	6,8%	13,6%	6,5%	10,8%	12,3%	11,8%
30.12.2019 bis 27.12.2021	15,0%	13,8%	13,3%	6,5%	-2,4%	9,8%	21,5%	13,6%	13,4%	9,2%	-0,3%

Annualisierte Volatilität	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003 bis 27.12.2004	23,8%	7,5%	11,3%	15,7%	14,6%	17,9%	19,7%	20,8%	24,8%	35,3%	33,6%
27.12.2004 bis 28.12.2009	23,5%	15,6%	17,3%	20,0%	21,9%	25,3%	25,4%	26,3%	30,9%	30,7%	39,6%
28.12.2009 bis 29.12.2014	17,4%	8,7%	11,4%	12,3%	13,3%	16,1%	19,3%	18,6%	20,9%	25,4%	31,1%
29.12.2014 bis 30.12.2019	15,7%	8,2%	10,4%	11,9%	13,2%	14,5%	15,0%	17,1%	17,7%	19,6%	23,1%
30.12.2019 bis 27.12.2021	23,2%	16,9%	18,2%	19,9%	20,9%	22,9%	23,5%	25,7%	27,3%	30,3%	36,1%

Maximaler Drawdown	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003 bis 27.12.2004	27,4%	5,8%	16,8%	21,5%	19,1%	27,7%	21,4%	29,4%	21,7%	46,4%	30,9%
27.12.2004 bis 28.12.2009	61,4%	42,1%	49,9%	49,9%	64,3%	67,5%	59,8%	58,8%	72,9%	72,4%	81,9%
28.12.2009 bis 29.12.2014	25,2%	11,3%	13,7%	18,7%	18,8%	26,0%	36,8%	34,0%	33,3%	45,4%	58,3%
29.12.2014 bis 30.12.2019	18,8%	8,8%	11,3%	10,1%	12,6%	23,4%	24,5%	31,5%	22,3%	27,2%	35,6%
30.12.2019 bis 27.12.2021	34,1%	29,4%	24,1%	27,5%	35,9%	33,2%	34,4%	37,5%	40,3%	39,1%	45,5%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum	Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
06.01.2003 bis 27.12.2004	25,1%	23,4%	7,5%	7,0%	5,9%	23,8%	4,9%	4,9%	27,4%
27.12.2004 bis 28.12.2009	4,7%	7,5%	4,1%	15,8%	12,2%	23,5%	41,4%	28,6%	61,4%
28.12.2009 bis 29.12.2014	12,2%	9,9%	8,1%	9,2%	7,4%	17,4%	14,4%	11,4%	25,2%
29.12.2014 bis 30.12.2019	10,4%	8,2%	9,4%	7,7%	6,2%	15,7%	7,9%	5,3%	18,8%
30.12.2019 bis 27.12.2021	15,9%	16,6%	15,0%	15,5%	9,7%	23,2%	22,8%	14,0%	34,1%

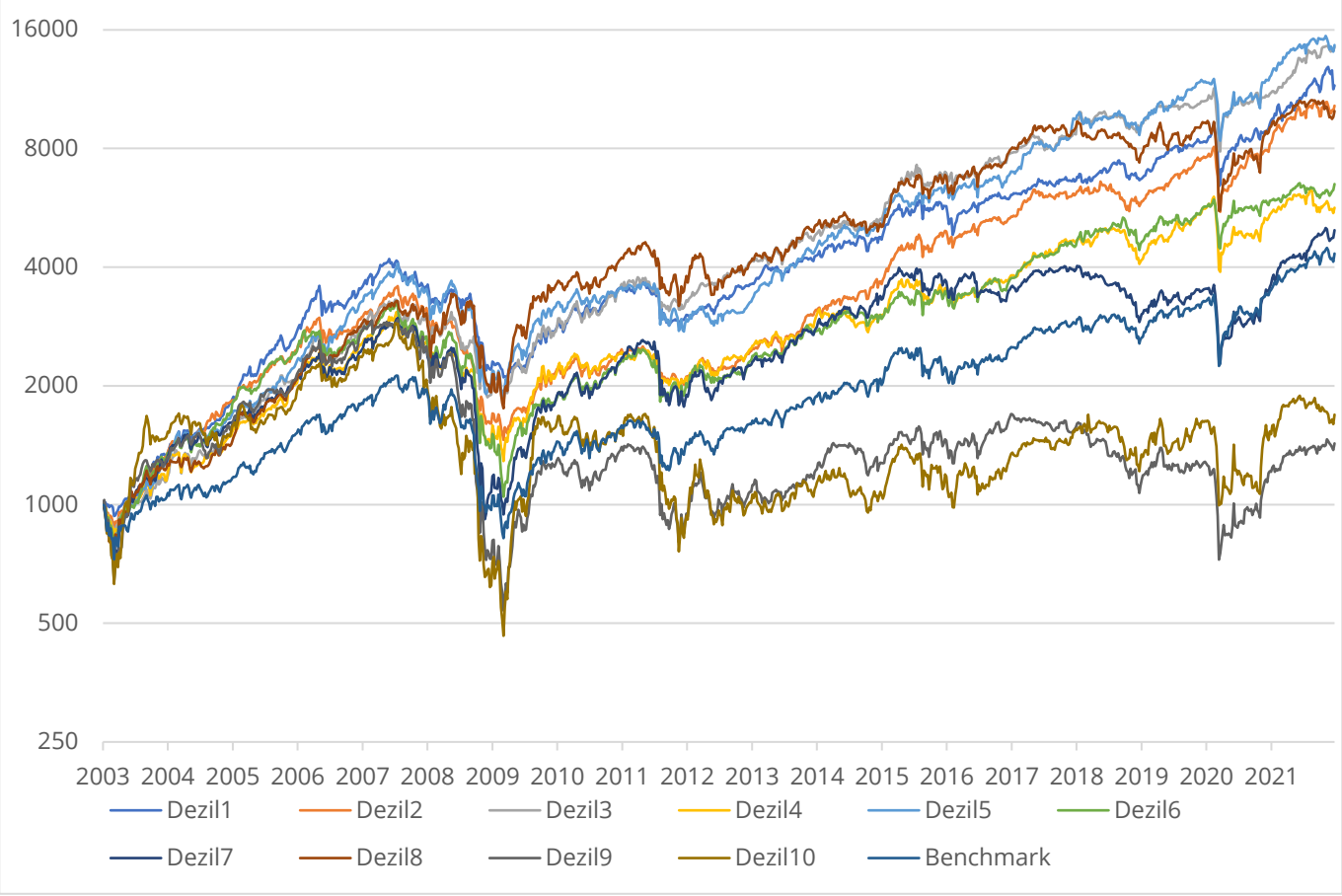
Technischer Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	06.01.2003	Region:	Niederlande + Belgien
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	AEX AllShare
Durchschnittliche Anzahl Aktien	122	Scoring-Modell:	Technischer Score

Dezilanalyse

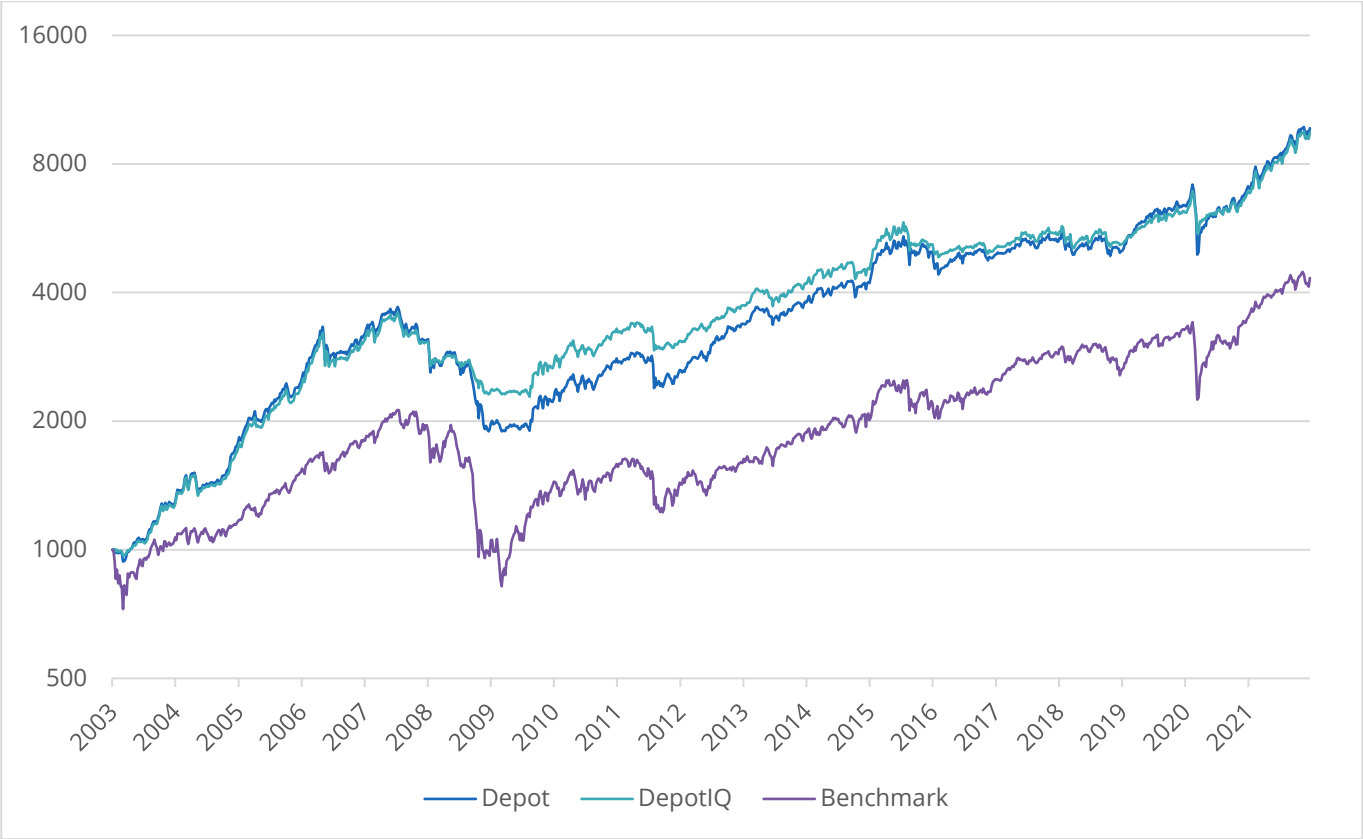
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	8,0%	13,7%	13,0%	15,1%	9,5%	15,1%	10,3%	8,8%	12,8%	1,9%	2,8%
Annualisierte Volatilität	20,1%	16,0%	16,3%	17,2%	18,1%	18,2%	19,1%	21,5%	21,9%	26,0%	31,6%
Maximaler Drawdown	61,4%	50,0%	59,2%	45,4%	58,1%	55,3%	67,7%	69,1%	48,8%	81,6%	83,9%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,398	0,858	0,799	0,876	0,525	0,829	0,542	0,408	0,586	0,073	0,088
Max 3 Jahre rollierend	121,1%	246,4%	223,9%	189,7%	184,7%	241,2%	244,0%	220,2%	222,4%	271,4%	246,2%
Min 3 Jahre rollierend	-49,2%	-37,7%	-46,8%	-25,9%	-43,3%	-29,0%	-60,8%	-58,1%	-34,7%	-77,4%	-78,6%
Max 5 Jahre rollierend	134,4%	259,3%	229,1%	238,6%	190,3%	340,5%	217,6%	235,7%	279,0%	249,5%	177,7%
Min 5 Jahre rollierend	-34,4%	-25,5%	-38,4%	9,7%	-29,1%	-25,5%	-35,3%	-40,7%	-10,4%	-68,8%	-71,5%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	66,8%	66,0%	79,6%	61,7%	78,7%	57,5%	51,9%	66,4%	38,3%	31,9%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	12,7%	12,5%	8,0%
Annualisierte Volatilität	16,5%	13,6%	20,1%
Maximaler Drawdown	48,9%	36,4%	61,4%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,769	0,921	0,398
Max 3 Jahre rollierend	223,4%	213,9%	121,1%
Min 3 Jahre rollierend	-41,7%	-27,4%	-49,2%
Max 5 Jahre rollierend	211,4%	207,6%	134,4%
Min 5 Jahre rollierend	-22,7%	-6,9%	-34,4%
Anteil Outperformance 1 Jahr	62,6%	58,7%	---

Anzahl Aktien im Depot	8	
Verkaufskriterium 1	Technisch	70%
Verkaufskriterium 2	Technisch	70%
Depotumschlagsfaktor	1,67	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
06.01.2003	bis	29.12.2003	22,9%	28,3%	35,3%
29.12.2003	bis	27.12.2004	26,5%	26,7%	1,0%
27.12.2004	bis	26.12.2005	8,9%	10,6%	-3,8%
26.12.2005	bis	25.12.2006	9,8%	6,5%	10,0%
25.12.2006	bis	31.12.2007	-10,5%	-5,1%	-19,0%
31.12.2007	bis	29.12.2008	12,3%	6,9%	-20,0%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-29,9%	-15,7%	67,4%
28.12.2009	bis	27.12.2010	13,2%	9,4%	-8,7%
27.12.2010	bis	26.12.2011	5,1%	-4,4%	-26,8%
26.12.2011	bis	31.12.2012	16,2%	5,4%	2,1%
31.12.2012	bis	30.12.2013	-5,4%	4,7%	-6,1%
30.12.2013	bis	29.12.2014	0,4%	4,0%	-10,3%
29.12.2014	bis	28.12.2015	10,8%	20,2%	5,8%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-13,7%	-5,2%	0,6%
26.12.2016	bis	25.12.2017	-7,9%	-3,9%	-11,4%
25.12.2017	bis	31.12.2018	4,0%	7,3%	-13,2%
31.12.2018	bis	30.12.2019	3,3%	3,0%	-3,5%
30.12.2019	bis	28.12.2020	3,0%	3,4%	-11,6%
28.12.2020	bis	27.12.2021	14,1%	0,6%	-10,7%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003	bis	27.12.2004	7,5%	35,0%	35,7%	23,9%	22,4%	29,9%	31,4%	27,2%	19,5%	25,6%	23,9%
27.12.2004	bis	28.12.2009	4,1%	8,8%	3,4%	12,4%	7,2%	13,5%	1,3%	2,7%	20,3%	-4,2%	0,6%
28.12.2009	bis	29.12.2014	8,1%	11,4%	11,2%	14,1%	7,4%	9,9%	10,6%	12,9%	7,5%	0,2%	-7,3%
29.12.2014	bis	30.12.2019	9,4%	11,8%	15,5%	14,7%	13,1%	18,3%	13,4%	0,8%	12,4%	0,1%	8,6%
30.12.2019	bis	27.12.2021	15,0%	17,8%	16,4%	17,1%	0,3%	11,2%	6,8%	18,7%	3,4%	5,6%	1,8%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003	bis	27.12.2004	23,8%	10,8%	14,3%	16,8%	19,3%	18,7%	17,4%	21,8%	23,7%	27,1%	32,5%
27.12.2004	bis	28.12.2009	23,5%	19,4%	19,5%	21,8%	22,4%	22,5%	25,5%	27,1%	26,8%	32,7%	38,5%
28.12.2009	bis	29.12.2014	17,4%	12,8%	13,9%	14,4%	14,9%	15,8%	16,9%	19,2%	18,5%	22,7%	29,4%
29.12.2014	bis	30.12.2019	15,7%	13,0%	13,3%	12,8%	12,8%	13,6%	14,3%	15,1%	15,6%	18,1%	23,5%
30.12.2019	bis	27.12.2021	23,2%	23,3%	21,2%	20,5%	23,4%	21,9%	17,5%	24,8%	27,2%	30,4%	35,2%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003	bis	27.12.2004	27,4%	7,6%	14,3%	16,9%	19,7%	26,5%	22,7%	30,3%	27,1%	38,0%	37,1%
27.12.2004	bis	28.12.2009	61,4%	50,0%	59,2%	45,4%	58,1%	55,3%	67,7%	69,1%	48,8%	81,6%	83,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	25,2%	22,6%	20,9%	19,1%	22,5%	24,9%	26,7%	32,2%	31,2%	43,6%	55,2%
29.12.2014	bis	30.12.2019	18,8%	18,2%	16,0%	15,0%	18,8%	13,2%	17,4%	27,9%	21,4%	37,0%	30,7%
30.12.2019	bis	27.12.2021	34,1%	31,0%	31,7%	30,8%	35,4%	30,4%	24,8%	36,6%	40,9%	43,5%	39,0%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
06.01.2003	bis	27.12.2004	32,4%	30,1%	7,5%	12,8%	11,8%	23,8%	10,6%	10,6%	27,4%
27.12.2004	bis	28.12.2009	4,9%	9,5%	4,1%	19,0%	15,9%	23,5%	48,9%	36,4%	61,4%
28.12.2009	bis	29.12.2014	13,8%	11,4%	8,1%	13,8%	11,6%	17,4%	17,6%	13,9%	25,2%
29.12.2014	bis	30.12.2019	8,6%	6,3%	9,4%	14,0%	12,0%	15,7%	18,6%	17,1%	18,8%
30.12.2019	bis	27.12.2021	23,0%	23,6%	15,0%	23,6%	17,1%	23,2%	31,5%	20,6%	34,1%

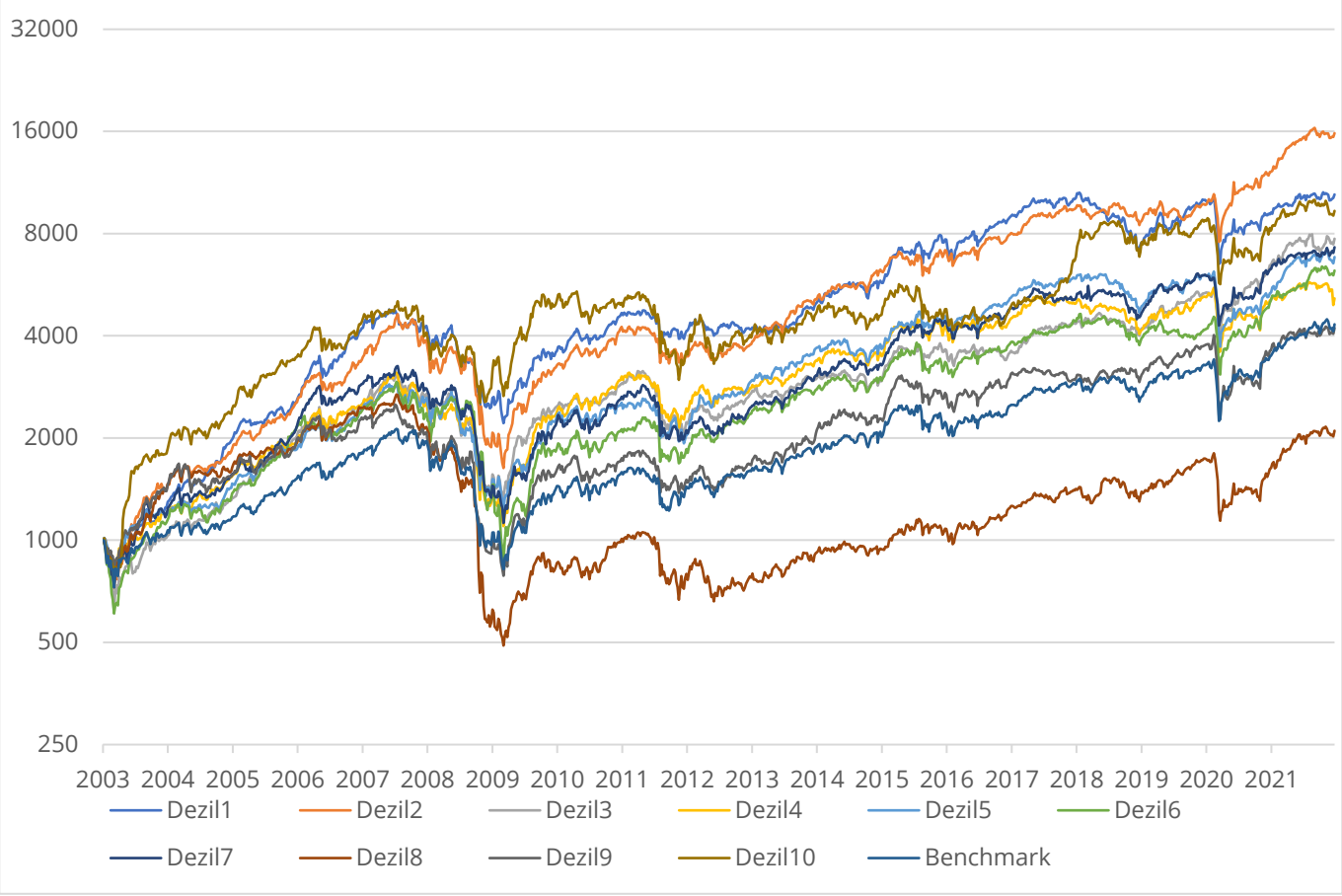
Value-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	06.01.2003	Region:	Niederlande + Belgien
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	AEX AllShare
Durchschnittliche Anzahl Aktien	118	Scoring-Modell:	Value-Score

Dezilanalyse

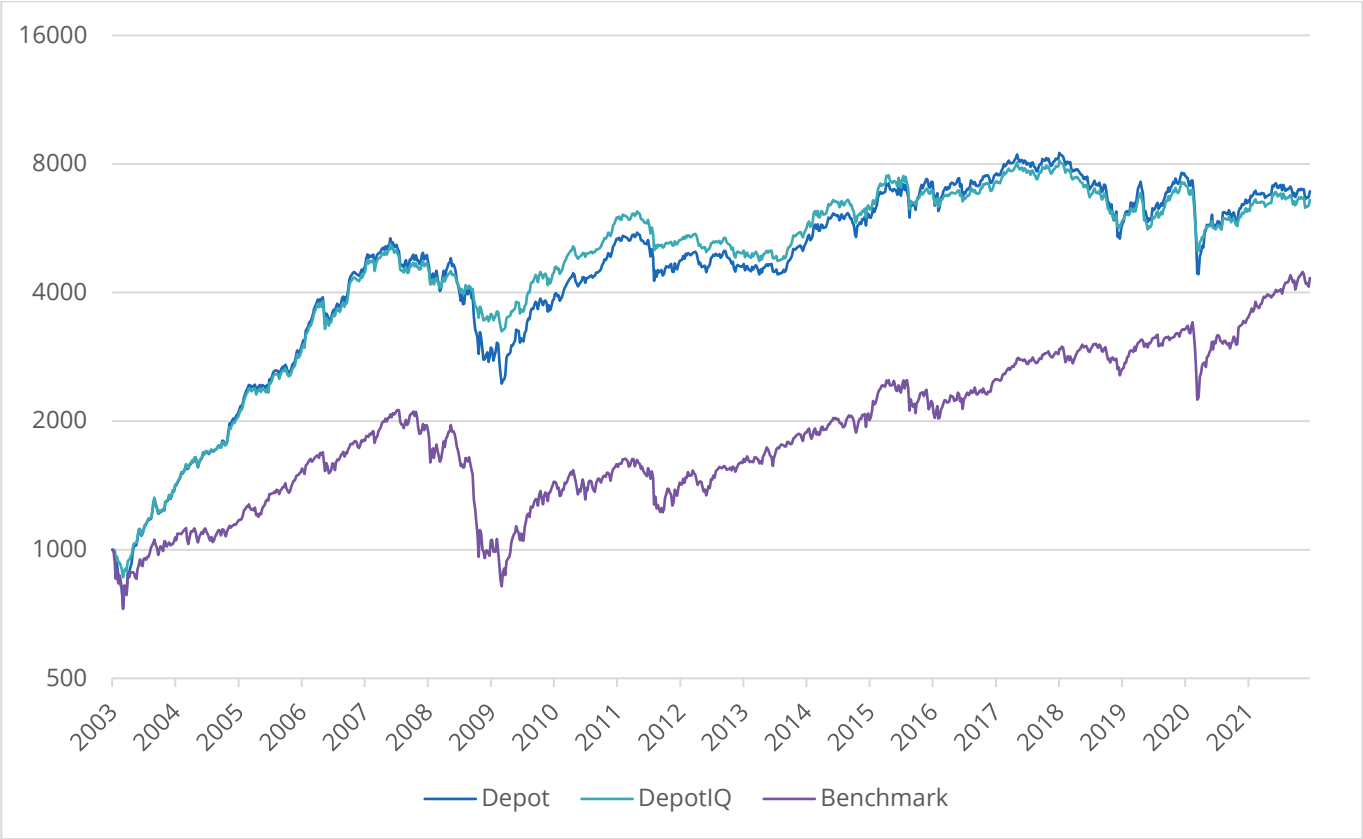
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	8,0%	13,1%	15,6%	11,3%	9,0%	10,6%	10,1%	11,0%	4,0%	7,9%	12,4%
Annualisierte Volatilität	20,1%	18,8%	19,6%	19,7%	19,4%	20,0%	22,0%	19,4%	23,0%	21,6%	25,2%
Maximaler Drawdown	61,4%	53,8%	64,7%	56,7%	64,7%	57,3%	70,7%	65,5%	81,8%	68,7%	49,8%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,398	0,699	0,796	0,574	0,464	0,532	0,457	0,567	0,173	0,363	0,495
Max 3 Jahre rollierend	121,1%	320,6%	305,1%	263,7%	172,8%	177,6%	251,7%	240,6%	173,0%	163,1%	412,0%
Min 3 Jahre rollierend	-49,2%	-32,4%	-44,3%	-39,9%	-49,5%	-41,9%	-60,0%	-56,8%	-76,9%	-64,0%	-32,9%
Max 5 Jahre rollierend	134,4%	437,4%	357,4%	296,3%	222,3%	219,3%	301,9%	242,3%	138,0%	178,2%	400,2%
Min 5 Jahre rollierend	-34,4%	-14,2%	-22,4%	-24,8%	-17,4%	-19,6%	-29,8%	-35,2%	-73,4%	-50,9%	-29,6%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	63,8%	74,9%	64,3%	49,8%	63,4%	64,3%	57,9%	42,6%	45,1%	41,3%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	10,7%	10,4%	8,0%
Annualisierte Volatilität	19,8%	15,0%	20,1%
Maximaler Drawdown	54,3%	38,6%	61,4%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,539	0,692	0,398
Max 3 Jahre rollierend	372,7%	309,0%	121,1%
Min 3 Jahre rollierend	-45,6%	-35,9%	-49,2%
Max 5 Jahre rollierend	481,8%	391,7%	134,4%
Min 5 Jahre rollierend	-35,4%	-30,2%	-34,4%
Anteil Outperformance 1 Jahr	53,2%	48,5%	---

Anzahl Aktien im Depot	8	
Verkaufskriterium 1	Value	90%
Verkaufskriterium 2	Value	90%
Depotumschlagsfaktor	1,15	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
06.01.2003	bis	29.12.2003	32,4%	29,2%	55,5%
29.12.2003	bis	27.12.2004	40,6%	32,3%	10,1%
27.12.2004	bis	26.12.2005	9,6%	2,9%	4,6%
26.12.2005	bis	25.12.2006	35,2%	29,2%	2,9%
25.12.2006	bis	31.12.2007	0,4%	0,3%	-16,0%
31.12.2007	bis	29.12.2008	8,1%	3,6%	6,8%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-10,5%	12,1%	28,9%
28.12.2009	bis	27.12.2010	26,8%	18,6%	-6,9%
27.12.2010	bis	26.12.2011	-0,6%	-4,0%	-10,7%
26.12.2011	bis	31.12.2012	-15,5%	-8,0%	-1,2%
31.12.2012	bis	30.12.2013	-4,7%	9,7%	2,9%
30.12.2013	bis	29.12.2014	6,7%	8,6%	-6,2%
29.12.2014	bis	28.12.2015	11,8%	16,3%	4,7%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-8,4%	2,1%	-5,8%
26.12.2016	bis	25.12.2017	-6,5%	-0,1%	2,3%
25.12.2017	bis	31.12.2018	-22,2%	-8,4%	12,6%
31.12.2018	bis	30.12.2019	10,1%	-0,7%	0,1%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-20,9%	1,7%	-10,5%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-18,1%	-2,4%	-10,2%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003 bis 27.12.2004	7,5%	40,6%	35,6%	14,7%	24,1%	19,7%	15,9%	24,9%	26,6%	24,4%	54,2%
27.12.2004 bis 28.12.2009	4,1%	12,6%	12,0%	13,4%	8,7%	9,5%	6,3%	7,0%	-12,2%	0,5%	15,9%
28.12.2009 bis 29.12.2014	8,1%	10,2%	14,2%	3,6%	8,8%	11,0%	10,6%	8,7%	2,5%	7,6%	-1,5%
29.12.2014 bis 30.12.2019	9,4%	11,5%	9,2%	12,7%	7,8%	9,8%	6,6%	12,8%	13,0%	10,4%	13,8%
30.12.2019 bis 27.12.2021	15,0%	1,8%	27,5%	20,2%	-0,5%	6,4%	22,2%	9,7%	10,0%	6,0%	3,1%

Annualisierte Volatilität	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003 bis 27.12.2004	23,8%	19,2%	23,1%	25,8%	15,4%	19,8%	23,0%	21,7%	23,0%	20,9%	32,0%
27.12.2004 bis 28.12.2009	23,5%	22,4%	25,3%	24,6%	24,1%	24,3%	30,2%	23,5%	29,8%	26,5%	26,7%
28.12.2009 bis 29.12.2014	17,4%	14,0%	15,0%	16,6%	16,4%	17,9%	17,6%	18,3%	21,1%	17,8%	25,1%
29.12.2014 bis 30.12.2019	15,7%	16,7%	14,3%	12,8%	15,1%	14,7%	14,6%	14,2%	14,6%	14,5%	19,6%
30.12.2019 bis 27.12.2021	23,2%	23,1%	21,2%	21,0%	25,5%	24,3%	22,8%	20,0%	25,2%	30,8%	25,9%

Maximaler Drawdown	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003 bis 27.12.2004	27,4%	27,4%	28,8%	39,1%	19,0%	25,5%	39,2%	25,9%	22,1%	18,5%	25,6%
27.12.2004 bis 28.12.2009	61,4%	53,8%	64,7%	56,7%	64,7%	57,3%	70,7%	65,5%	81,8%	68,7%	49,8%
28.12.2009 bis 29.12.2014	25,2%	18,6%	22,1%	35,8%	31,1%	26,3%	26,8%	31,5%	37,4%	24,9%	45,1%
29.12.2014 bis 30.12.2019	18,8%	32,9%	15,0%	14,3%	22,5%	23,0%	20,8%	20,4%	15,6%	21,9%	26,7%
30.12.2019 bis 27.12.2021	34,1%	36,5%	27,6%	26,4%	35,4%	40,0%	32,5%	29,2%	36,8%	43,4%	36,0%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum	Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
06.01.2003 bis 27.12.2004	44,3%	42,9%	7,5%	19,6%	14,1%	23,8%	26,1%	13,8%	27,4%
27.12.2004 bis 28.12.2009	13,0%	16,8%	4,1%	22,8%	16,8%	23,5%	54,3%	37,7%	61,4%
28.12.2009 bis 29.12.2014	9,8%	7,7%	8,1%	14,6%	12,4%	17,4%	23,0%	23,5%	25,2%
29.12.2014 bis 30.12.2019	4,4%	2,5%	9,4%	19,0%	14,7%	15,7%	37,0%	30,9%	18,8%
30.12.2019 bis 27.12.2021	-4,7%	-4,6%	15,0%	24,8%	17,4%	23,2%	41,9%	31,0%	34,1%

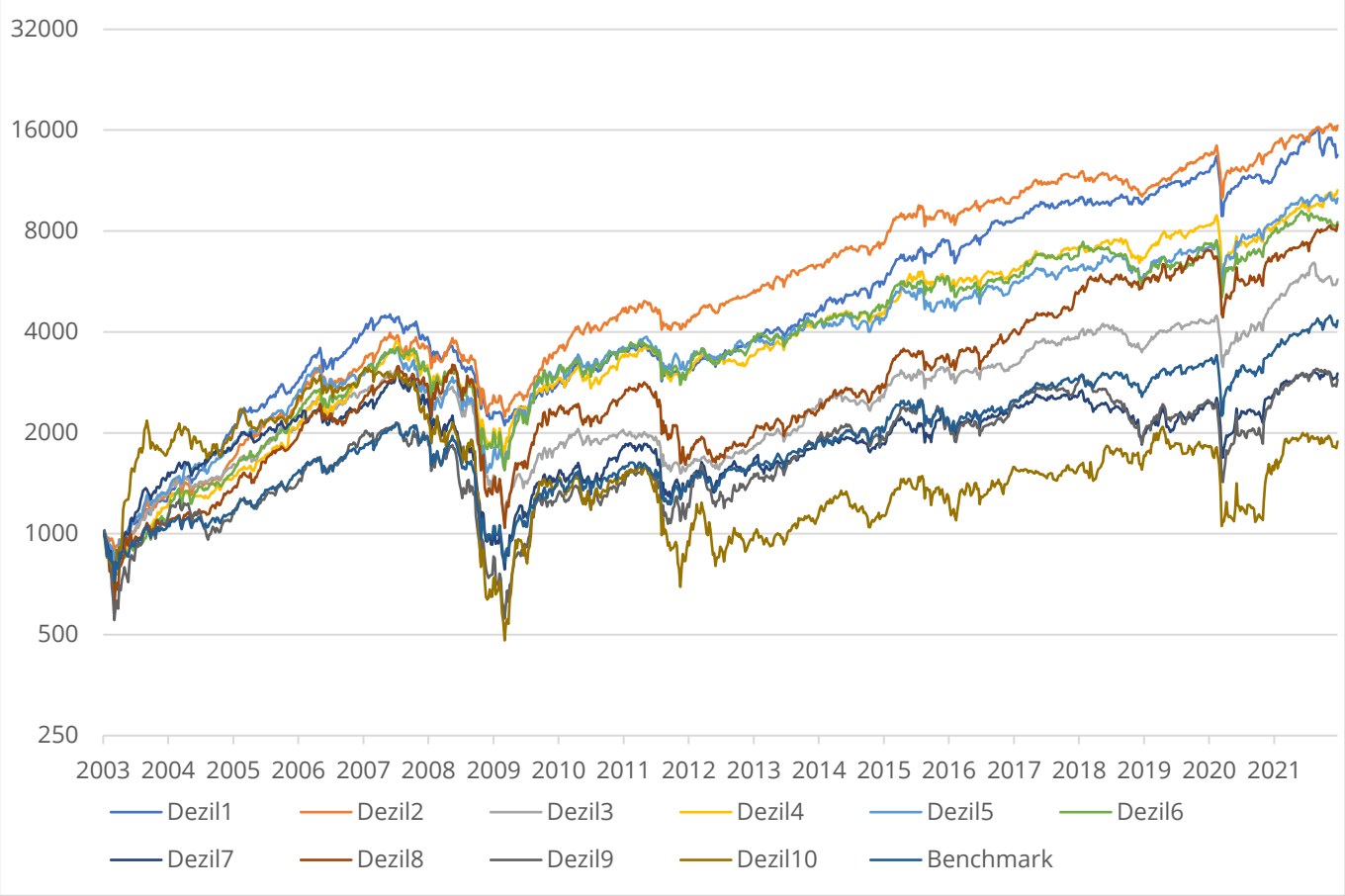
Kombi-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	06.01.2003	Region:	Niederlande + Belgien
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	AEX AllShare
Durchschnittliche Anzahl Aktien	118	Scoring-Modell:	Kombi-Score

Dezilanalyse

	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	8,0%	14,6%	15,9%	9,6%	13,2%	12,9%	11,9%	6,0%	11,8%	5,7%	3,4%
Annualisierte Volatilität	20,1%	16,3%	16,3%	17,4%	17,9%	19,3%	20,1%	21,7%	23,8%	25,8%	31,3%
Maximaler Drawdown	61,4%	53,4%	43,9%	62,7%	54,8%	57,3%	57,0%	74,3%	67,4%	74,0%	84,7%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,398	0,897	0,977	0,552	0,737	0,666	0,593	0,274	0,497	0,221	0,108
Max 3 Jahre rollierend	121,1%	286,9%	225,0%	206,4%	216,9%	268,8%	283,4%	210,2%	269,2%	190,2%	253,4%
Min 3 Jahre rollierend	-49,2%	-36,7%	-21,9%	-52,1%	-27,9%	-45,9%	-39,6%	-65,0%	-53,7%	-65,2%	-82,3%
Max 5 Jahre rollierend	134,4%	314,1%	282,4%	241,5%	296,4%	208,9%	327,7%	204,3%	351,6%	249,0%	172,8%
Min 5 Jahre rollierend	-34,4%	-28,0%	14,2%	-48,7%	-11,7%	-5,3%	-8,8%	-53,3%	-46,1%	-53,2%	-76,2%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	75,3%	78,7%	56,2%	66,0%	58,3%	66,0%	34,0%	72,8%	45,5%	36,6%

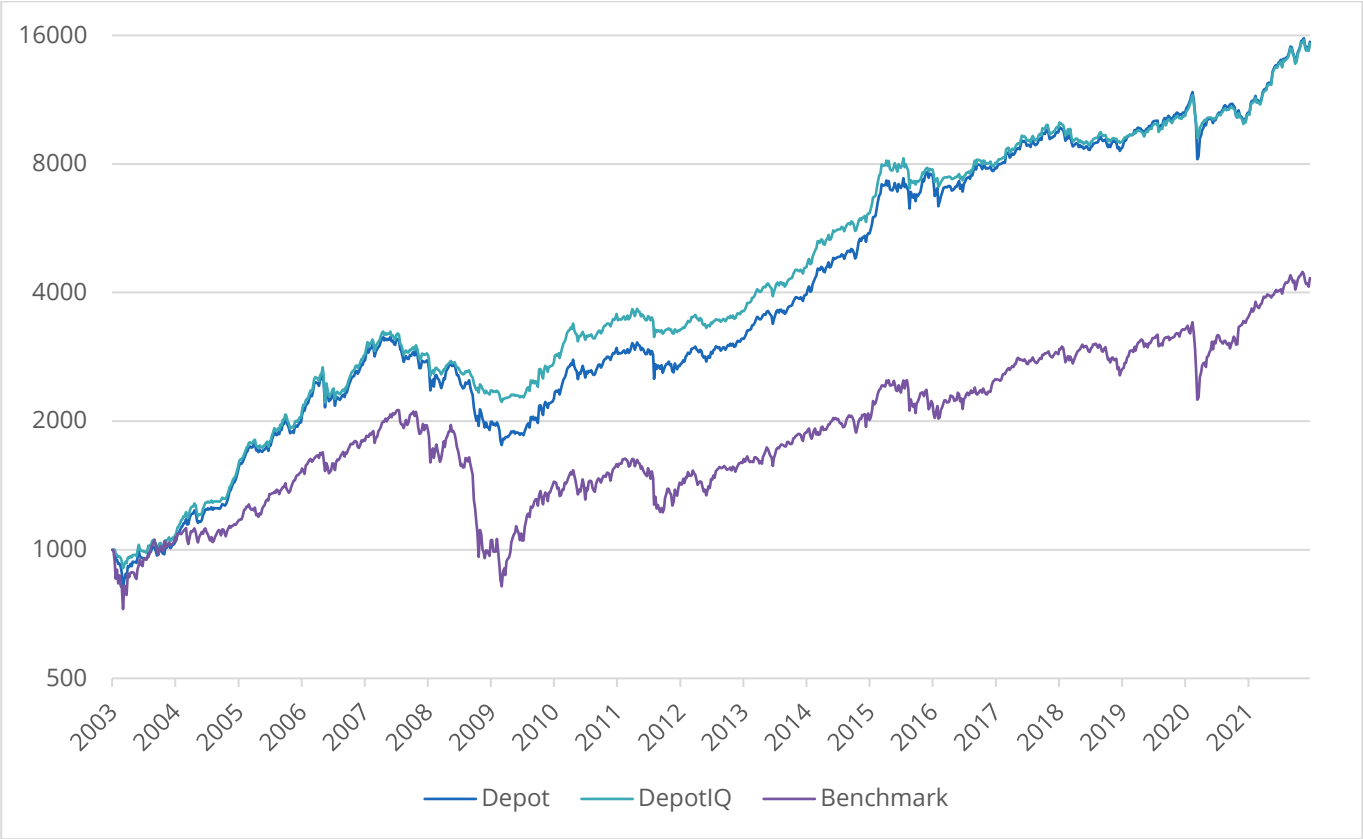


Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	15,5%	15,4%	8,0%
Annualisierte Volatilität	16,4%	13,4%	20,1%
Maximaler Drawdown	44,2%	31,6%	61,4%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,944	1,151	0,398

Anzahl Aktien im Depot	8	
Verkaufskriterium 1	Kombi	70%
Verkaufskriterium 2	Kombi	70%
Depotumschlagsfaktor	1,26	

Max 3 Jahre rollierend	186,5%	175,0%	121,1%
Min 3 Jahre rollierend	-27,2%	-13,7%	-49,2%
Max 5 Jahre rollierend	222,1%	192,0%	134,4%
Min 5 Jahre rollierend	-10,3%	4,0%	-34,4%
Anteil Outperformance 1 Jahr	74,9%	67,7%	---



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
06.01.2003	bis	29.12.2003	-1,3%	23,3%	36,0%
29.12.2003	bis	27.12.2004	33,7%	34,6%	-3,1%
27.12.2004	bis	26.12.2005	2,9%	10,9%	-5,2%
26.12.2005	bis	25.12.2006	17,3%	16,3%	12,3%
25.12.2006	bis	31.12.2007	-6,5%	-2,4%	-21,1%
31.12.2007	bis	29.12.2008	19,1%	12,9%	-15,8%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-29,5%	-12,0%	45,9%
28.12.2009	bis	27.12.2010	20,1%	19,7%	-3,3%
27.12.2010	bis	26.12.2011	3,5%	-0,5%	-16,3%
26.12.2011	bis	31.12.2012	1,6%	9,7%	0,6%
31.12.2012	bis	30.12.2013	8,6%	3,6%	5,9%
30.12.2013	bis	29.12.2014	28,4%	8,5%	-9,1%
29.12.2014	bis	28.12.2015	30,3%	20,9%	6,5%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-9,0%	0,6%	2,6%
26.12.2016	bis	25.12.2017	6,8%	-0,3%	-8,1%
25.12.2017	bis	31.12.2018	0,6%	2,7%	-4,2%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-3,4%	3,0%	-2,7%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-7,0%	-6,2%	-12,2%
28.12.2020	bis	27.12.2021	23,1%	-7,5%	-8,2%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003 bis 27.12.2004	7,5%	43,5%	28,8%	25,9%	20,7%	34,7%	22,8%	34,2%	16,0%	5,7%	39,3%
27.12.2004 bis 28.12.2009	4,1%	6,2%	16,1%	2,6%	14,2%	10,8%	14,2%	-3,9%	11,3%	2,8%	-6,3%
28.12.2009 bis 29.12.2014	8,1%	15,3%	16,1%	7,6%	10,0%	7,7%	10,4%	4,8%	4,0%	8,7%	-3,9%
29.12.2014 bis 30.12.2019	9,4%	16,2%	13,0%	10,3%	12,7%	10,1%	8,8%	5,7%	20,1%	5,1%	10,0%
30.12.2019 bis 27.12.2021	15,0%	6,0%	10,3%	16,3%	12,8%	18,7%	7,7%	10,7%	9,1%	7,3%	1,6%

Annualisierte Volatilität	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003 bis 27.12.2004	23,8%	15,0%	13,8%	18,4%	16,0%	20,7%	24,5%	21,2%	29,2%	32,7%	32,5%
27.12.2004 bis 28.12.2009	23,5%	18,6%	20,6%	22,0%	23,3%	25,3%	25,5%	26,6%	29,2%	29,9%	37,7%
28.12.2009 bis 29.12.2014	17,4%	13,7%	13,2%	14,2%	14,0%	16,0%	15,9%	19,9%	21,4%	23,1%	29,0%
29.12.2014 bis 30.12.2019	15,7%	12,8%	12,7%	12,5%	12,6%	14,3%	14,2%	16,9%	16,1%	17,2%	22,2%
30.12.2019 bis 27.12.2021	23,2%	23,8%	20,6%	21,0%	23,6%	19,7%	22,0%	23,4%	24,8%	31,7%	37,3%

Maximaler Drawdown	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003 bis 27.12.2004	27,4%	17,5%	10,6%	22,1%	25,5%	20,3%	33,3%	29,3%	40,2%	46,0%	23,2%
27.12.2004 bis 28.12.2009	61,4%	53,4%	43,9%	62,7%	54,8%	57,3%	57,0%	74,3%	67,4%	74,0%	84,7%
28.12.2009 bis 29.12.2014	25,2%	22,2%	18,1%	26,5%	21,2%	22,2%	25,6%	31,7%	43,1%	32,3%	56,4%
29.12.2014 bis 30.12.2019	18,8%	15,2%	15,9%	17,7%	15,3%	17,7%	25,4%	31,2%	14,2%	37,5%	26,3%
30.12.2019 bis 27.12.2021	34,1%	34,0%	30,3%	29,6%	37,3%	25,5%	32,7%	33,7%	37,1%	43,1%	42,4%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum	Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
06.01.2003 bis 27.12.2004	22,2%	23,6%	7,5%	13,9%	10,9%	23,8%	18,4%	9,5%	27,4%
27.12.2004 bis 28.12.2009	8,3%	12,1%	4,1%	18,8%	15,9%	23,5%	44,2%	31,6%	61,4%
28.12.2009 bis 29.12.2014	19,8%	17,7%	8,1%	13,7%	11,3%	17,4%	17,8%	14,2%	25,2%
29.12.2014 bis 30.12.2019	13,9%	11,0%	9,4%	15,0%	12,5%	15,7%	17,0%	15,0%	18,8%
30.12.2019 bis 27.12.2021	21,0%	21,6%	15,0%	21,1%	15,8%	23,2%	30,4%	20,5%	34,1%

Frankreich – SBF250

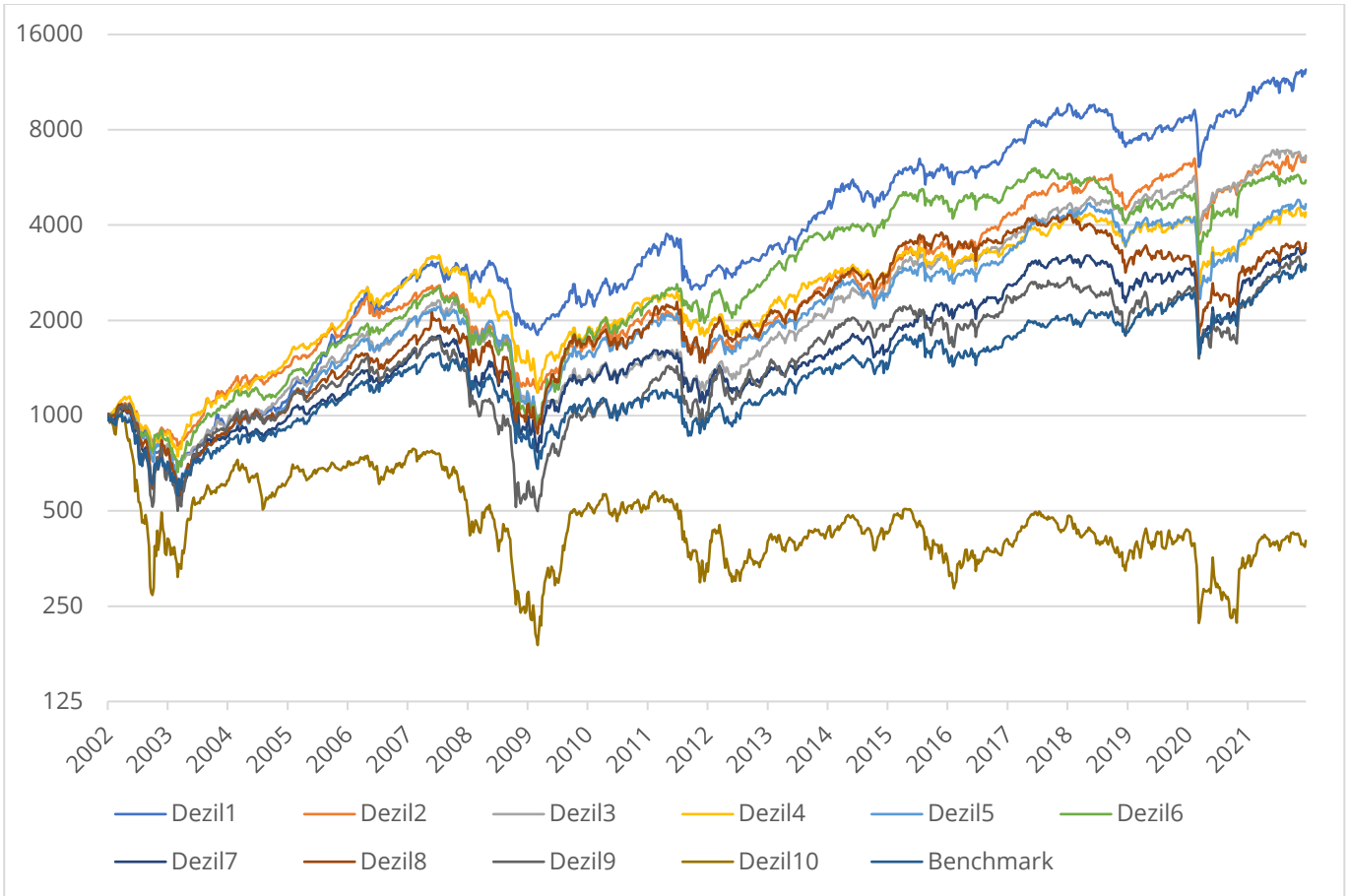
Trend-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Frankreich
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	CAC40
Durchschnittliche Anzahl Aktien	185	Scoring-Modell:	Trend-Score

Dezilanalyse

	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	5,6%	13,4%	9,8%	9,9%	7,7%	8,0%	8,9%	6,3%	6,5%	5,7%	-4,4%
Annualisierte Volatilität	22,0%	19,8%	18,4%	18,3%	18,9%	20,1%	19,4%	21,5%	23,4%	25,6%	32,2%
Maximaler Drawdown	57,0%	41,7%	54,2%	58,9%	63,2%	58,8%	62,7%	57,2%	58,7%	71,8%	81,6%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,257	0,675	0,535	0,542	0,406	0,398	0,459	0,294	0,276	0,222	-0,138
Max 3 Jahre rollierend	118,9%	233,0%	172,9%	157,8%	219,2%	185,4%	172,3%	157,4%	176,4%	182,7%	162,0%
Min 3 Jahre rollierend	-45,7%	-23,5%	-46,4%	-47,0%	-50,1%	-45,4%	-48,0%	-43,1%	-54,3%	-64,4%	-73,5%
Max 5 Jahre rollierend	144,6%	305,8%	211,9%	221,4%	276,4%	206,1%	302,4%	190,8%	219,6%	277,5%	139,3%
Min 5 Jahre rollierend	-39,6%	-8,5%	-36,0%	-42,2%	-42,6%	-27,1%	-34,7%	-33,4%	-47,8%	-50,5%	-72,8%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	71,8%	66,1%	75,0%	54,4%	64,1%	68,6%	54,8%	57,3%	51,6%	22,6%

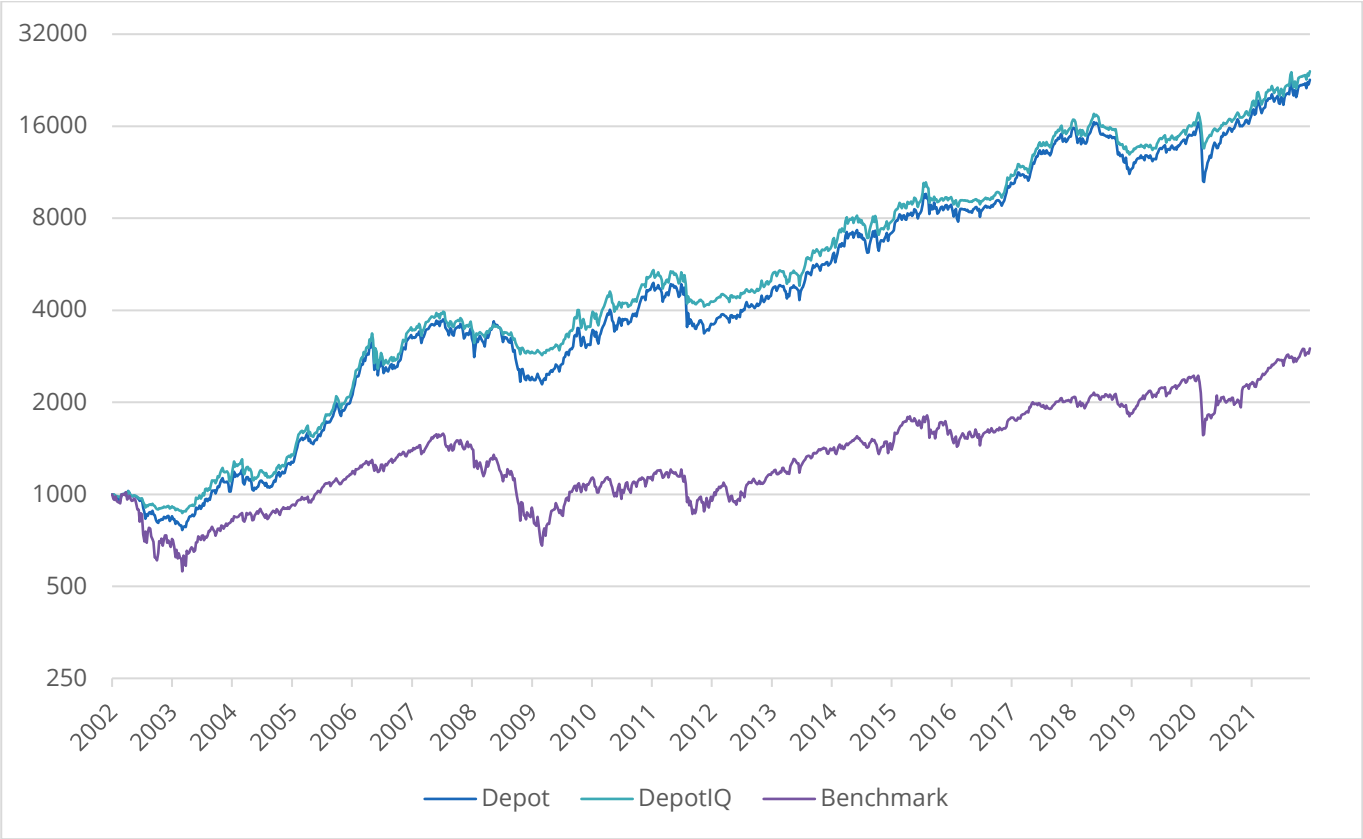


Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	16,8%	17,2%	5,6%
Annualisierte Volatilität	22,4%	19,1%	22,0%
Maximaler Drawdown	38,7%	27,9%	57,0%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,751	0,901	0,257

Max 3 Jahre rollierend	272,5%	263,3%	118,9%
Min 3 Jahre rollierend	-20,3%	-10,5%	-45,7%
Max 5 Jahre rollierend	347,0%	335,4%	144,6%
Min 5 Jahre rollierend	2,1%	12,4%	-39,6%
Anteil Outperformance 1 Jahr	77,4%	75,8%	---

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Trend	70%
Verkaufskriterium 2	Trend	70%
Depotumschlagsfaktor	1,65	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	15,4%	15,3%	-17,9%
30.12.2002	bis	29.12.2003	3,3%	3,2%	35,4%
29.12.2003	bis	27.12.2004	10,0%	10,8%	-4,9%
27.12.2004	bis	26.12.2005	31,4%	19,5%	-7,6%
26.12.2005	bis	25.12.2006	46,1%	16,9%	-8,4%
25.12.2006	bis	31.12.2007	0,8%	-1,9%	-22,3%
31.12.2007	bis	29.12.2008	9,7%	2,6%	-15,8%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-0,8%	-5,8%	64,9%
28.12.2009	bis	27.12.2010	49,5%	31,3%	7,1%
27.12.2010	bis	26.12.2011	-8,2%	-4,9%	-11,4%
26.12.2011	bis	31.12.2012	3,7%	0,3%	6,7%
31.12.2012	bis	30.12.2013	6,1%	16,0%	-0,8%
30.12.2013	bis	29.12.2014	20,5%	1,5%	1,4%
29.12.2014	bis	28.12.2015	13,1%	16,3%	-16,9%
28.12.2015	bis	26.12.2016	7,0%	8,6%	4,5%
26.12.2016	bis	25.12.2017	31,3%	14,1%	-2,0%
25.12.2017	bis	31.12.2018	-13,2%	-7,7%	-16,1%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-0,9%	-2,3%	-2,0%
30.12.2019	bis	28.12.2020	17,4%	6,0%	-10,5%
28.12.2020	bis	27.12.2021	3,7%	-9,8%	-5,9%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	-3,1%	3,4%	12,5%	6,1%	13,8%	2,2%	7,9%	-1,0%	1,0%	1,2%	-15,4%
27.12.2004	bis	28.12.2009	4,0%	15,5%	3,1%	2,0%	4,0%	7,6%	7,1%	6,1%	10,4%	-0,6%	-3,5%
28.12.2009	bis	29.12.2014	5,8%	16,9%	9,8%	12,9%	9,3%	9,5%	18,5%	4,4%	10,4%	13,9%	-3,3%
29.12.2014	bis	30.12.2019	10,3%	11,9%	18,6%	16,9%	8,2%	11,8%	3,6%	12,5%	2,8%	5,1%	0,3%
30.12.2019	bis	27.12.2021	11,8%	19,1%	2,5%	11,9%	2,7%	4,9%	5,7%	8,2%	4,7%	10,2%	-4,0%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	26,9%	15,2%	13,3%	15,1%	16,7%	18,2%	17,5%	22,7%	24,5%	30,5%	44,8%
27.12.2004	bis	28.12.2009	22,7%	21,0%	19,0%	20,3%	21,6%	21,9%	22,1%	24,3%	27,0%	26,4%	31,3%
28.12.2009	bis	29.12.2014	20,3%	21,7%	18,6%	18,7%	17,3%	17,7%	17,5%	18,6%	20,7%	22,3%	26,5%
29.12.2014	bis	30.12.2019	17,3%	16,2%	15,6%	15,3%	14,6%	15,2%	15,6%	16,4%	16,7%	19,6%	24,5%
30.12.2019	bis	27.12.2021	26,3%	25,7%	27,3%	22,6%	26,7%	31,5%	27,2%	29,4%	31,6%	34,9%	41,6%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	44,9%	34,5%	26,9%	36,5%	35,3%	42,1%	38,8%	50,9%	48,6%	53,9%	73,5%
27.12.2004	bis	28.12.2009	57,0%	41,7%	54,2%	58,9%	63,2%	58,8%	62,7%	57,2%	58,7%	71,8%	76,1%
28.12.2009	bis	29.12.2014	28,5%	33,3%	29,5%	26,1%	27,6%	28,4%	24,5%	31,9%	35,9%	36,1%	48,3%
29.12.2014	bis	30.12.2019	21,2%	26,7%	22,3%	17,2%	21,9%	26,8%	33,2%	29,1%	34,2%	34,7%	44,0%
30.12.2019	bis	27.12.2021	36,2%	34,1%	42,6%	33,5%	40,4%	44,9%	35,5%	44,5%	44,0%	40,9%	49,4%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	7,8%	9,8%	-3,1%	16,9%	14,5%	26,9%	25,6%	15,2%	44,9%
27.12.2004	bis	28.12.2009	19,7%	21,7%	4,0%	24,5%	21,0%	22,7%	38,7%	27,9%	57,0%
28.12.2009	bis	29.12.2014	18,1%	16,9%	5,8%	24,2%	21,2%	20,3%	31,7%	24,0%	28,5%
29.12.2014	bis	30.12.2019	16,0%	15,6%	10,3%	18,9%	16,0%	17,3%	32,4%	26,4%	21,2%
30.12.2019	bis	27.12.2021	23,2%	22,8%	11,8%	27,7%	21,9%	26,3%	36,2%	23,4%	36,2%

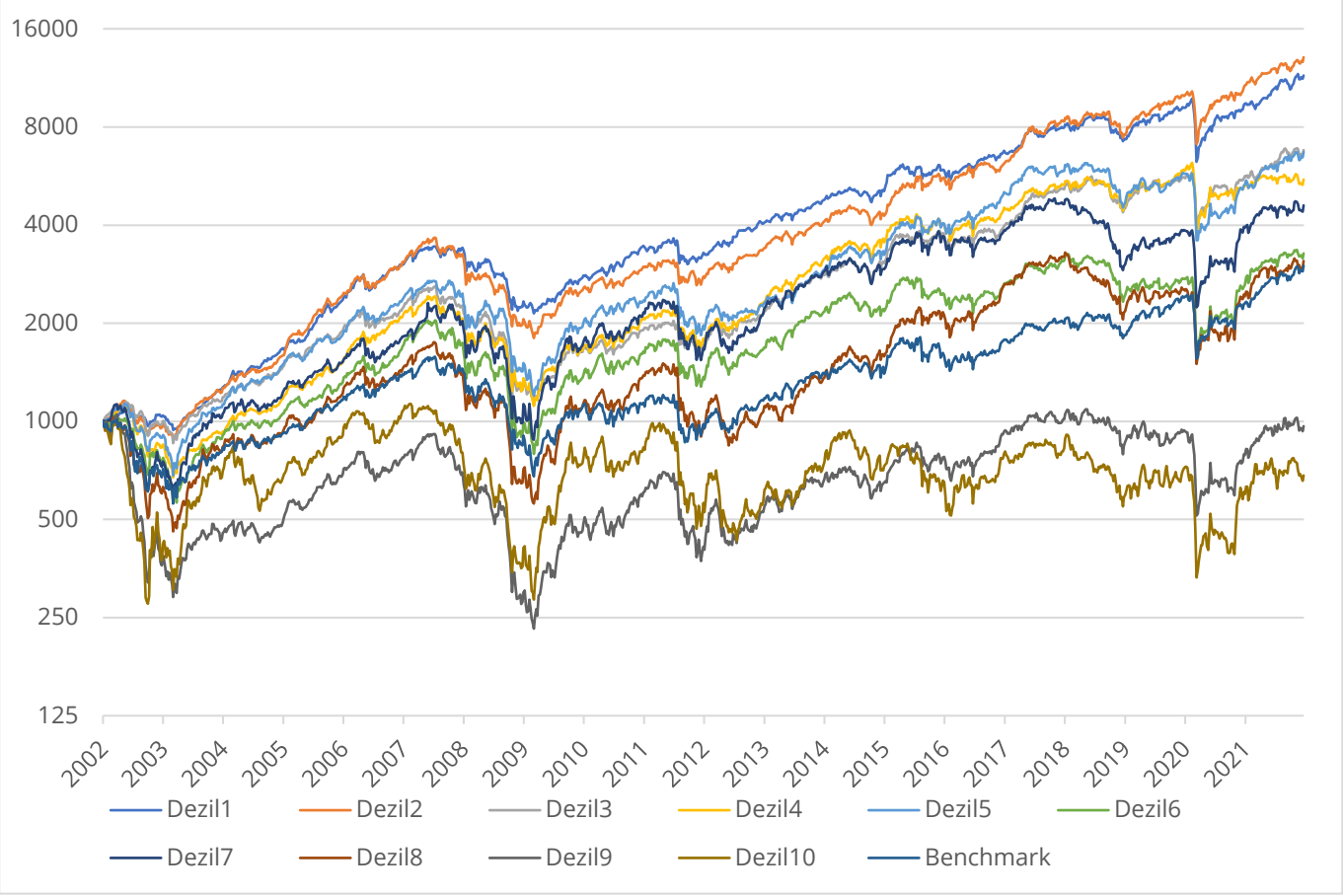
Safety-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Frankreich
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	CAC40
Durchschnittliche Anzahl Aktien	185	Scoring-Modell:	Safety-Score

Dezilanalyse

	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	5,6%	13,0%	13,7%	10,0%	8,9%	10,0%	6,1%	7,9%	5,8%	-0,2%	-1,9%
Annualisierte Volatilität	22,0%	13,8%	14,8%	16,2%	17,5%	19,1%	22,0%	23,7%	25,3%	27,8%	35,5%
Maximaler Drawdown	57,0%	37,6%	50,9%	56,7%	54,0%	55,6%	61,1%	62,0%	68,1%	78,0%	74,9%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,257	0,943	0,926	0,622	0,510	0,523	0,277	0,334	0,230	-0,006	-0,053
Max 3 Jahre rollierend	118,9%	185,6%	201,4%	139,5%	156,3%	205,1%	165,8%	183,6%	196,6%	161,5%	249,4%
Min 3 Jahre rollierend	-45,7%	-20,7%	-33,2%	-45,6%	-36,2%	-42,7%	-44,6%	-47,0%	-59,0%	-68,8%	-72,8%
Max 5 Jahre rollierend	144,6%	252,6%	273,3%	167,9%	194,3%	232,5%	189,3%	256,9%	258,8%	190,1%	237,8%
Min 5 Jahre rollierend	-39,6%	1,0%	-18,9%	-27,8%	-20,4%	-23,8%	-40,1%	-36,5%	-50,0%	-54,1%	-64,4%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	76,2%	77,0%	67,3%	71,4%	67,3%	53,6%	62,5%	57,7%	44,4%	38,3%

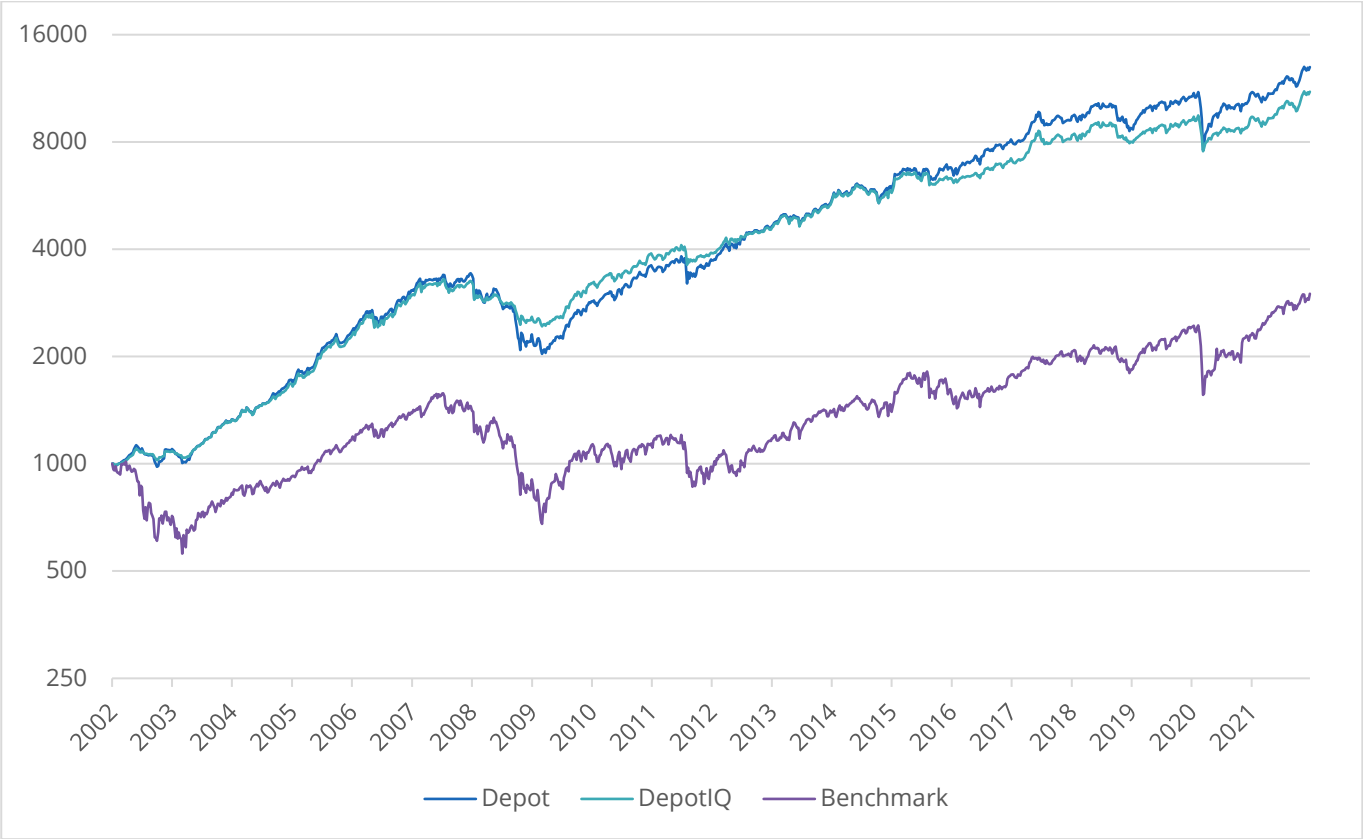


Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	13,6%	12,7%	5,6%
Annualisierte Volatilität	13,8%	10,7%	22,0%
Maximaler Drawdown	40,6%	26,1%	57,0%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,986	1,195	0,257

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Safety	80%
Verkaufskriterium 2	Safety	80%
Depotumschlagsfaktor	0,73	

Max 3 Jahre rollierend	162,7%	149,6%	118,9%
Min 3 Jahre rollierend	-23,5%	-6,4%	-45,7%
Max 5 Jahre rollierend	233,1%	219,3%	144,6%
Min 5 Jahre rollierend	13,6%	15,8%	-39,6%
Anteil Outperformance 1 Jahr	75,0%	69,4%	---



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	41,5%	32,1%	-30,5%
30.12.2002	bis	29.12.2003	0,4%	4,9%	29,9%
29.12.2003	bis	27.12.2004	18,6%	18,2%	-9,0%
27.12.2004	bis	26.12.2005	6,5%	18,9%	11,1%
26.12.2005	bis	25.12.2006	11,9%	8,2%	-2,2%
25.12.2006	bis	31.12.2007	8,2%	5,4%	-22,3%
31.12.2007	bis	29.12.2008	6,2%	5,3%	-15,7%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-2,9%	-6,3%	55,0%
28.12.2009	bis	27.12.2010	25,3%	18,6%	16,2%
27.12.2010	bis	26.12.2011	18,7%	9,5%	-18,9%
26.12.2011	bis	31.12.2012	1,8%	1,9%	-0,2%
31.12.2012	bis	30.12.2013	-4,1%	-2,1%	4,9%
30.12.2013	bis	29.12.2014	7,4%	2,8%	-6,3%
29.12.2014	bis	28.12.2015	2,6%	11,7%	-3,6%
28.12.2015	bis	26.12.2016	9,3%	2,3%	8,4%
26.12.2016	bis	25.12.2017	0,1%	13,4%	-6,3%
25.12.2017	bis	31.12.2018	4,4%	0,7%	-13,4%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-8,7%	-2,7%	-13,4%
30.12.2019	bis	28.12.2020	6,3%	8,6%	-11,1%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-11,7%	-7,5%	-13,6%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002 bis 27.12.2004	-3,1%	18,7%	16,6%	13,1%	5,2%	13,8%	1,4%	6,1%	-2,9%	-22,0%	-13,3%
27.12.2004 bis 28.12.2009	4,0%	10,6%	9,8%	2,5%	7,3%	5,8%	5,4%	7,5%	3,9%	-0,7%	2,6%
28.12.2009 bis 29.12.2014	5,8%	13,2%	11,4%	13,6%	17,0%	11,2%	10,2%	11,4%	7,7%	6,9%	-1,0%
29.12.2014 bis 30.12.2019	10,3%	12,2%	18,0%	12,6%	10,2%	11,6%	4,3%	5,7%	9,5%	7,8%	0,3%
30.12.2019 bis 27.12.2021	11,8%	12,1%	14,6%	10,1%	-3,4%	7,9%	9,5%	9,0%	10,6%	1,4%	-2,5%

Annualisierte Volatilität	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002 bis 27.12.2004	26,9%	7,9%	11,0%	12,6%	14,4%	17,3%	20,8%	23,4%	27,5%	33,2%	48,5%
27.12.2004 bis 28.12.2009	22,7%	15,1%	16,7%	18,1%	20,3%	21,3%	24,3%	28,2%	27,0%	28,4%	32,4%
28.12.2009 bis 29.12.2014	20,3%	11,9%	13,2%	14,2%	15,7%	17,5%	19,9%	21,0%	24,0%	27,6%	32,7%
29.12.2014 bis 30.12.2019	17,3%	12,5%	13,8%	14,1%	14,5%	15,5%	16,5%	17,5%	18,4%	19,3%	26,9%
30.12.2019 bis 27.12.2021	26,3%	22,2%	19,9%	23,6%	24,0%	26,4%	32,6%	30,7%	34,4%	34,9%	44,9%

Maximaler Drawdown	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002 bis 27.12.2004	44,9%	14,0%	23,6%	25,4%	39,6%	39,8%	46,2%	48,0%	55,4%	72,6%	72,5%
27.12.2004 bis 28.12.2009	57,0%	37,6%	50,9%	56,7%	54,0%	55,6%	61,1%	62,0%	68,1%	74,7%	74,9%
28.12.2009 bis 29.12.2014	28,5%	16,7%	16,4%	20,8%	22,9%	30,9%	28,6%	34,7%	44,0%	46,7%	56,5%
29.12.2014 bis 30.12.2019	21,2%	16,8%	16,9%	22,5%	21,2%	27,1%	28,6%	39,8%	37,7%	27,3%	39,9%
30.12.2019 bis 27.12.2021	36,2%	36,0%	31,1%	34,8%	37,3%	37,6%	42,8%	42,2%	41,0%	45,4%	54,4%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum	Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002 bis 27.12.2004	20,0%	18,9%	-3,1%	8,4%	6,1%	26,9%	13,0%	7,1%	44,9%
27.12.2004 bis 28.12.2009	10,4%	13,6%	4,0%	16,1%	12,0%	22,7%	40,6%	26,1%	57,0%
28.12.2009 bis 29.12.2014	16,2%	12,9%	5,8%	12,9%	10,4%	20,3%	16,1%	12,1%	28,5%
29.12.2014 bis 30.12.2019	12,1%	9,4%	10,3%	12,1%	10,3%	17,3%	16,4%	12,8%	21,2%
30.12.2019 bis 27.12.2021	10,2%	9,8%	11,8%	19,7%	13,4%	26,3%	31,3%	20,6%	36,2%

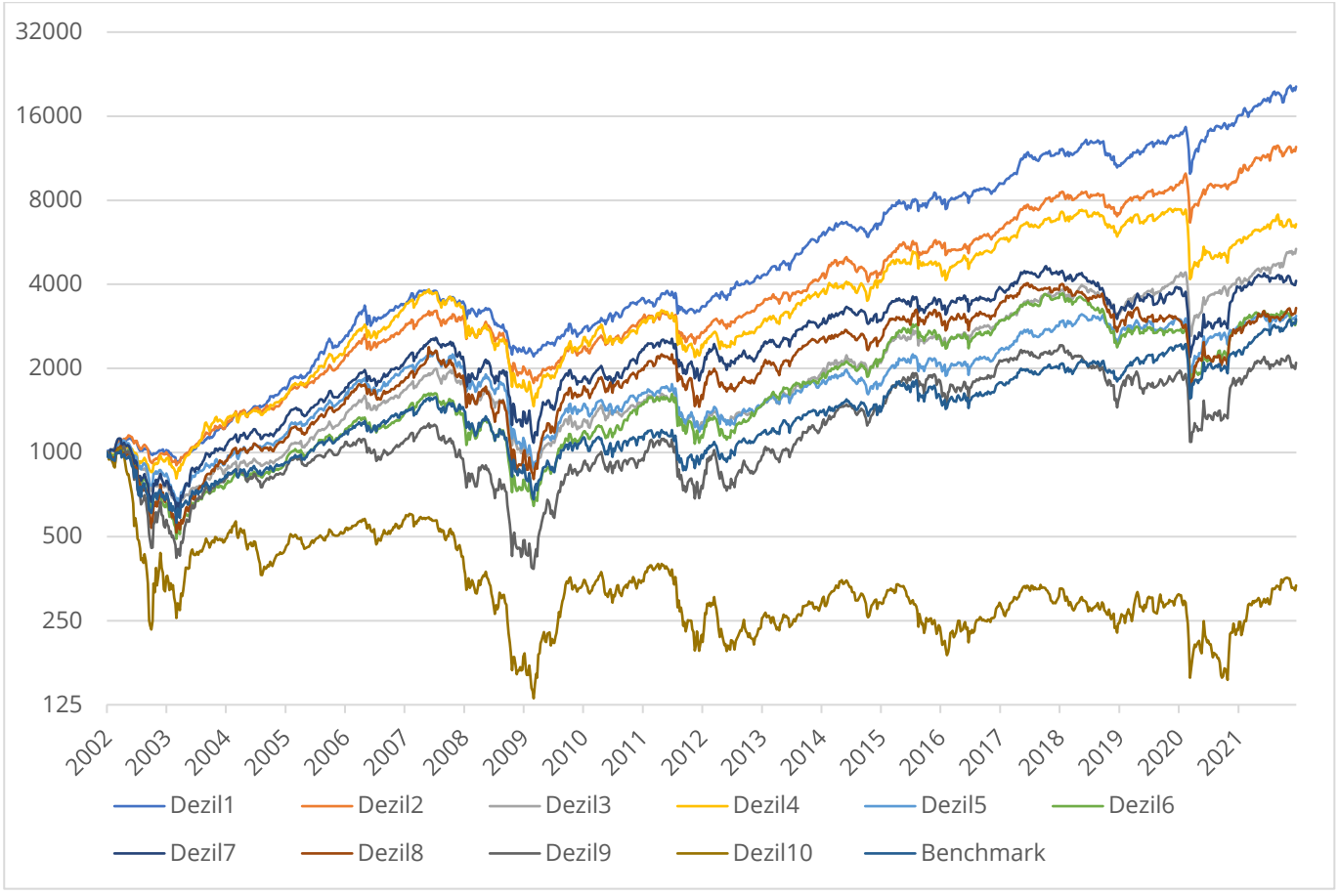
Technischer Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Frankreich
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	CAC40
Durchschnittliche Anzahl Aktien	185	Scoring-Modell:	Technischer Score

Dezilanalyse

	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	5,6%	16,3%	13,4%	8,7%	9,8%	5,8%	5,5%	7,3%	6,1%	3,8%	-5,3%
Annualisierte Volatilität	22,0%	15,3%	16,5%	17,9%	19,7%	19,8%	21,4%	22,0%	23,3%	26,9%	33,9%
Maximaler Drawdown	57,0%	42,4%	44,9%	56,4%	61,8%	61,6%	60,5%	57,9%	66,3%	69,8%	87,4%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,257	1,064	0,813	0,489	0,500	0,292	0,259	0,333	0,263	0,140	-0,157
Max 3 Jahre rollierend	118,9%	237,6%	165,5%	134,6%	228,5%	177,1%	164,2%	200,5%	226,3%	158,8%	128,5%
Min 3 Jahre rollierend	-45,7%	-28,0%	-27,7%	-41,9%	-44,7%	-50,0%	-50,2%	-45,5%	-53,9%	-64,2%	-75,9%
Max 5 Jahre rollierend	144,6%	272,4%	229,4%	175,6%	321,6%	186,8%	206,2%	266,1%	284,9%	252,6%	137,7%
Min 5 Jahre rollierend	-39,6%	-6,9%	-11,1%	-33,7%	-36,6%	-44,7%	-32,3%	-36,7%	-44,0%	-55,9%	-75,3%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	80,7%	79,8%	66,9%	65,7%	54,4%	60,9%	63,7%	56,1%	48,4%	31,1%

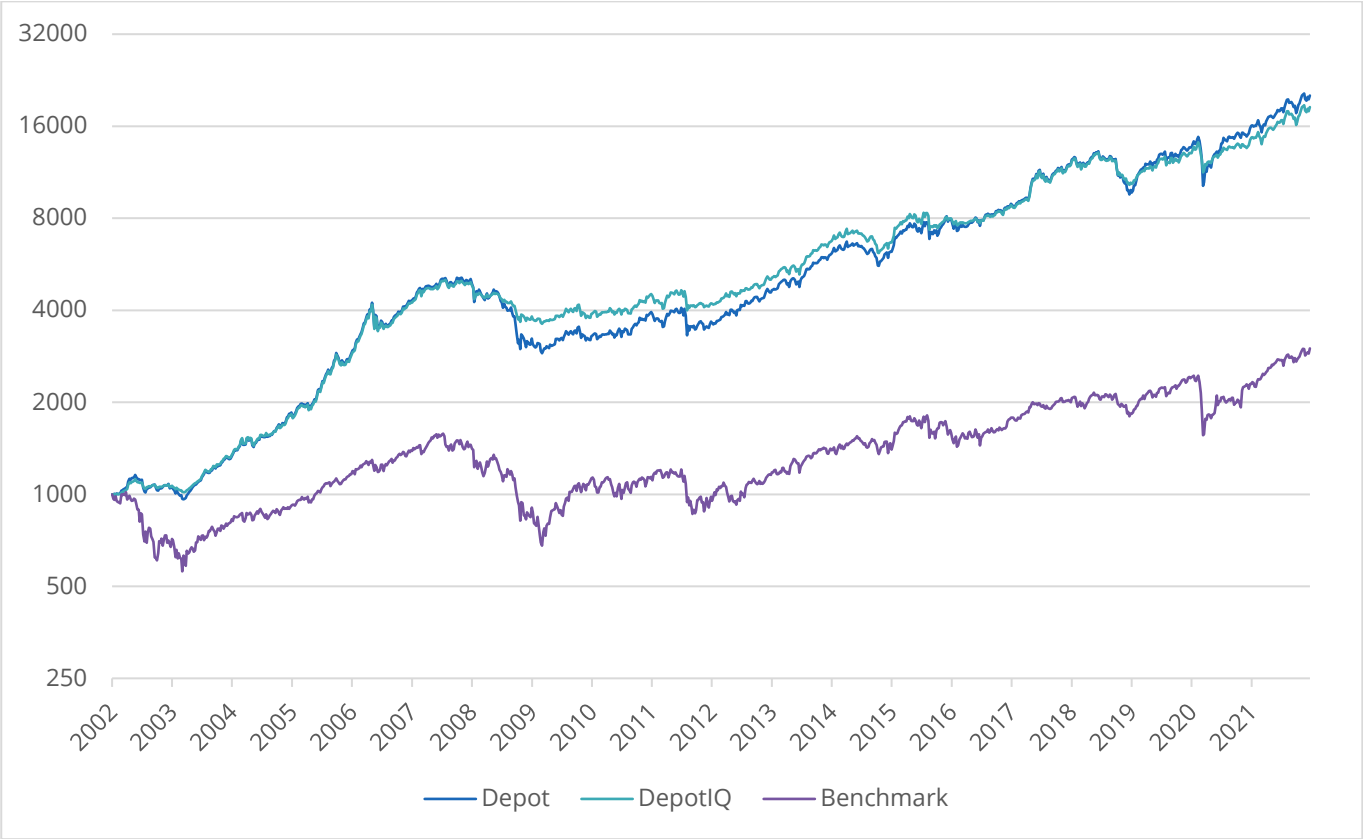


Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	16,2%	15,7%	5,6%
Annualisierte Volatilität	17,1%	14,0%	22,0%
Maximaler Drawdown	43,4%	28,1%	57,0%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,947	1,120	0,257

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Technisch	70%
Verkaufskriterium 2	Technisch	70%
Depotumschlagsfaktor	1,46	

Max 3 Jahre rollierend	302,1%	290,7%	118,9%
Min 3 Jahre rollierend	-35,5%	-22,4%	-45,7%
Max 5 Jahre rollierend	401,6%	380,8%	144,6%
Min 5 Jahre rollierend	-21,7%	-8,7%	-39,6%
Anteil Outperformance 1 Jahr	77,0%	71,8%	---



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	37,6%	32,1%	-24,5%
30.12.2002	bis	29.12.2003	4,6%	2,3%	28,7%
29.12.2003	bis	27.12.2004	27,5%	21,1%	-13,8%
27.12.2004	bis	26.12.2005	25,8%	15,3%	-6,9%
26.12.2005	bis	25.12.2006	33,8%	13,0%	-11,9%
25.12.2006	bis	31.12.2007	12,6%	2,1%	-23,9%
31.12.2007	bis	29.12.2008	3,0%	6,6%	-15,6%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-27,9%	-14,0%	68,6%
28.12.2009	bis	27.12.2010	20,9%	28,6%	3,4%
27.12.2010	bis	26.12.2011	7,9%	6,6%	-14,8%
26.12.2011	bis	31.12.2012	4,6%	6,3%	-0,6%
31.12.2012	bis	30.12.2013	11,3%	11,1%	2,8%
30.12.2013	bis	29.12.2014	-2,1%	3,3%	5,8%
29.12.2014	bis	28.12.2015	17,8%	16,6%	-4,7%
28.12.2015	bis	26.12.2016	1,5%	0,6%	6,4%
26.12.2016	bis	25.12.2017	21,4%	17,3%	-5,0%
25.12.2017	bis	31.12.2018	-8,3%	-2,1%	-17,6%
31.12.2018	bis	30.12.2019	7,4%	-3,7%	-4,1%
30.12.2019	bis	28.12.2020	19,9%	14,6%	-10,9%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-2,7%	-0,4%	-1,1%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002 bis 27.12.2004	-3,1%	19,4%	16,0%	-0,7%	15,9%	4,4%	-3,6%	8,4%	3,1%	-5,8%	-24,1%
27.12.2004 bis 28.12.2009	4,0%	9,7%	8,1%	4,8%	9,3%	4,6%	5,0%	7,1%	8,0%	0,8%	-5,4%
28.12.2009 bis 29.12.2014	5,8%	19,5%	13,8%	11,2%	11,2%	4,4%	13,4%	10,7%	9,2%	10,3%	-2,6%
29.12.2014 bis 30.12.2019	10,3%	15,5%	15,5%	15,0%	12,4%	11,2%	4,9%	5,5%	3,7%	6,3%	1,2%
30.12.2019 bis 27.12.2021	11,8%	22,5%	17,1%	12,2%	-6,1%	1,4%	3,7%	2,8%	4,7%	4,3%	4,1%

Annualisierte Volatilität	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002 bis 27.12.2004	26,9%	9,1%	11,5%	14,4%	15,4%	18,5%	21,8%	22,8%	25,3%	29,9%	47,6%
27.12.2004 bis 28.12.2009	22,7%	16,7%	18,6%	19,4%	21,9%	21,1%	23,6%	25,1%	26,5%	29,2%	30,8%
28.12.2009 bis 29.12.2014	20,3%	14,3%	16,2%	17,3%	19,6%	19,2%	20,0%	18,9%	19,8%	24,8%	29,4%
29.12.2014 bis 30.12.2019	17,3%	14,5%	14,1%	14,3%	15,2%	16,2%	15,9%	16,9%	17,6%	19,9%	25,7%
30.12.2019 bis 27.12.2021	26,3%	22,0%	22,5%	26,4%	28,1%	27,1%	29,6%	30,2%	31,2%	35,4%	44,1%

Maximaler Drawdown	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002 bis 27.12.2004	44,9%	17,9%	21,9%	40,6%	24,0%	42,8%	52,5%	45,9%	51,0%	60,1%	77,7%
27.12.2004 bis 28.12.2009	57,0%	42,4%	44,9%	56,4%	61,8%	61,6%	60,5%	57,9%	66,3%	69,8%	78,2%
28.12.2009 bis 29.12.2014	28,5%	17,1%	22,7%	25,7%	32,1%	32,6%	33,7%	29,1%	35,1%	38,9%	51,3%
29.12.2014 bis 30.12.2019	21,2%	20,4%	18,4%	23,9%	21,2%	21,6%	36,0%	35,2%	33,0%	40,2%	44,3%
30.12.2019 bis 27.12.2021	36,2%	32,0%	33,2%	40,8%	43,8%	39,8%	37,2%	43,8%	44,3%	44,4%	50,6%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum	Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002 bis 27.12.2004	22,5%	22,1%	-3,1%	11,0%	8,9%	26,9%	16,7%	9,4%	44,9%
27.12.2004 bis 28.12.2009	11,7%	15,8%	4,0%	19,7%	16,2%	22,7%	43,4%	28,1%	57,0%
28.12.2009 bis 29.12.2014	14,2%	12,0%	5,8%	15,4%	13,0%	20,3%	18,7%	16,7%	28,5%
29.12.2014 bis 30.12.2019	16,9%	14,3%	10,3%	16,3%	14,0%	17,3%	27,7%	21,6%	21,2%
30.12.2019 bis 27.12.2021	21,7%	18,9%	11,8%	22,7%	16,4%	26,3%	30,9%	20,2%	36,2%

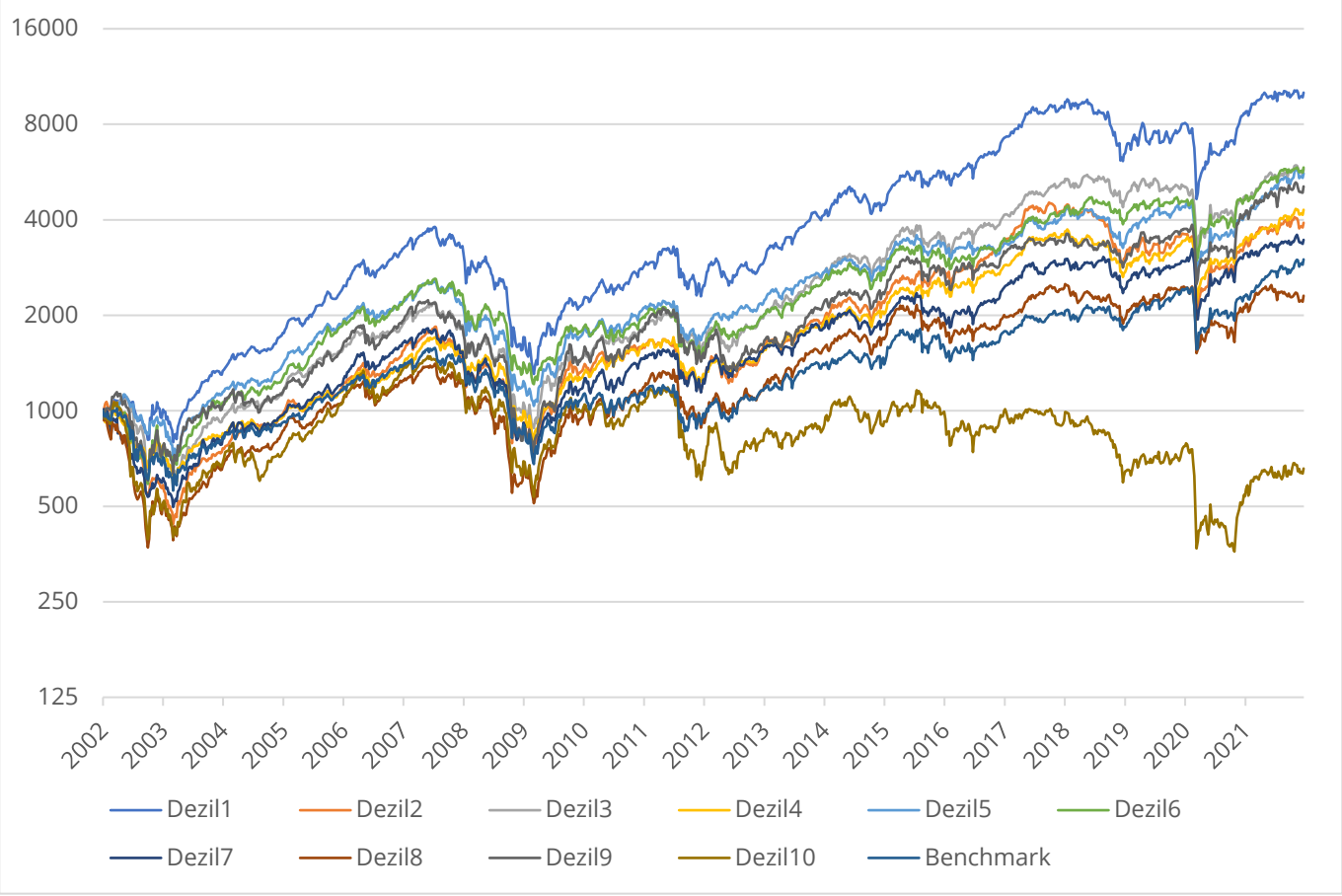
Value-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Frankreich
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	CAC40
Durchschnittliche Anzahl Aktien	176	Scoring-Modell:	Value-Score

Dezilanalyse

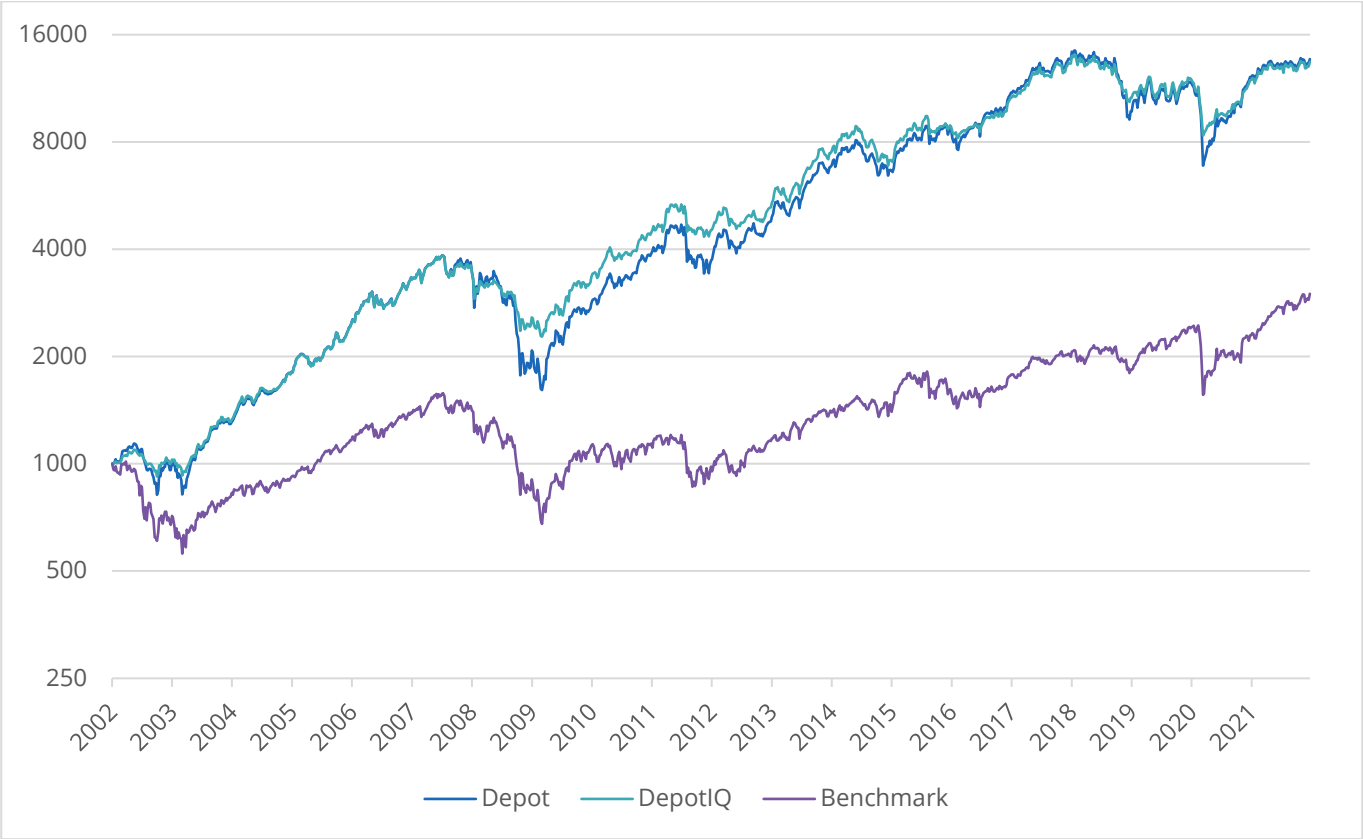
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	5,6%	12,2%	7,1%	9,1%	7,6%	9,0%	9,2%	6,4%	4,3%	8,5%	-2,1%
Annualisierte Volatilität	22,0%	21,6%	20,5%	20,5%	18,7%	19,4%	20,4%	20,9%	23,5%	23,7%	28,2%
Maximaler Drawdown	57,0%	65,6%	59,6%	59,9%	53,3%	59,6%	53,5%	60,9%	63,7%	66,8%	75,8%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,257	0,565	0,344	0,447	0,404	0,464	0,453	0,306	0,181	0,358	-0,073
Max 3 Jahre rollierend	118,9%	250,7%	190,3%	186,3%	119,8%	193,3%	212,9%	181,8%	204,7%	182,8%	206,0%
Min 3 Jahre rollierend	-45,7%	-53,1%	-46,5%	-48,7%	-37,8%	-50,0%	-39,6%	-50,4%	-56,6%	-58,0%	-63,3%
Max 5 Jahre rollierend	144,6%	335,8%	256,5%	228,1%	166,6%	187,5%	318,2%	229,6%	247,1%	226,8%	243,9%
Min 5 Jahre rollierend	-39,6%	-32,5%	-31,7%	-27,5%	-21,9%	-23,8%	-33,4%	-28,5%	-29,0%	-38,7%	-66,1%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	71,4%	60,1%	67,7%	64,9%	63,3%	70,6%	60,5%	49,2%	59,7%	35,5%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	13,9%	13,8%	5,6%
Annualisierte Volatilität	21,8%	16,1%	22,0%
Maximaler Drawdown	58,1%	40,8%	57,0%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,639	0,858	0,257
Max 3 Jahre rollierend	240,2%	200,9%	118,9%
Min 3 Jahre rollierend	-42,2%	-27,4%	-45,7%
Max 5 Jahre rollierend	359,0%	287,6%	144,6%
Min 5 Jahre rollierend	-11,4%	-0,2%	-39,6%
Anteil Outperformance 1 Jahr	76,2%	75,8%	---

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Value	90%
Verkaufskriterium 2	Value	90%
Depotumschlagsfaktor	1,40	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	28,6%	8,7%	-7,2%
30.12.2002	bis	29.12.2003	14,6%	13,3%	19,0%
29.12.2003	bis	27.12.2004	25,7%	18,9%	-2,5%
27.12.2004	bis	26.12.2005	7,9%	2,4%	13,8%
26.12.2005	bis	25.12.2006	17,0%	12,3%	6,2%
25.12.2006	bis	31.12.2007	6,8%	-4,2%	-10,4%
31.12.2007	bis	29.12.2008	-7,3%	-6,3%	-10,8%
29.12.2008	bis	28.12.2009	14,5%	17,8%	39,1%
28.12.2009	bis	27.12.2010	38,6%	21,6%	10,8%
27.12.2010	bis	26.12.2011	10,6%	-2,3%	-12,0%
26.12.2011	bis	31.12.2012	10,0%	4,0%	-4,4%
31.12.2012	bis	30.12.2013	20,4%	9,1%	0,0%
30.12.2013	bis	29.12.2014	-6,1%	7,8%	1,3%
29.12.2014	bis	28.12.2015	21,0%	16,6%	4,1%
28.12.2015	bis	26.12.2016	14,8%	14,8%	-5,0%
26.12.2016	bis	25.12.2017	11,7%	11,9%	-12,3%
25.12.2017	bis	31.12.2018	-19,7%	-20,5%	-13,8%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-9,6%	-8,0%	-4,1%
30.12.2019	bis	28.12.2020	7,4%	3,9%	-4,9%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-18,3%	-13,3%	-9,1%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	-3,1%	20,0%	-1,2%	3,8%	-1,9%	11,2%	7,6%	-1,2%	-5,5%	4,1%	-10,3%
27.12.2004	bis	28.12.2009	4,0%	4,6%	6,8%	5,6%	6,2%	4,9%	7,6%	4,0%	2,4%	5,4%	6,7%
28.12.2009	bis	29.12.2014	5,8%	15,6%	10,5%	15,4%	10,0%	10,1%	8,8%	9,7%	12,2%	10,0%	-2,3%
29.12.2014	bis	30.12.2019	10,3%	12,4%	10,3%	11,1%	10,8%	9,2%	10,7%	9,6%	7,7%	9,6%	-2,9%
30.12.2019	bis	27.12.2021	11,8%	11,9%	4,2%	6,2%	11,8%	12,7%	13,3%	8,1%	-3,3%	16,5%	-7,7%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	26,9%	21,0%	20,5%	21,1%	21,0%	19,0%	25,5%	22,4%	29,9%	29,7%	32,5%
27.12.2004	bis	28.12.2009	22,7%	24,6%	22,4%	23,5%	20,5%	21,4%	20,3%	22,2%	24,8%	24,5%	26,2%
28.12.2009	bis	29.12.2014	20,3%	19,3%	18,2%	16,7%	16,3%	16,8%	18,8%	19,6%	21,8%	22,2%	27,3%
29.12.2014	bis	30.12.2019	17,3%	18,6%	16,1%	16,2%	14,9%	15,6%	15,5%	15,8%	16,2%	16,8%	22,2%
30.12.2019	bis	27.12.2021	26,3%	26,8%	29,4%	28,3%	24,0%	27,6%	26,0%	28,8%	28,8%	29,3%	39,8%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	44,9%	28,3%	58,9%	44,1%	42,8%	37,4%	44,6%	51,0%	62,9%	47,4%	63,1%
27.12.2004	bis	28.12.2009	57,0%	65,6%	59,6%	59,9%	53,3%	59,6%	53,5%	60,9%	63,7%	66,8%	64,0%
28.12.2009	bis	29.12.2014	28,5%	30,4%	31,9%	25,0%	29,0%	27,1%	31,3%	26,8%	34,4%	36,9%	49,0%
29.12.2014	bis	30.12.2019	21,2%	36,2%	36,1%	21,2%	29,3%	25,6%	17,9%	23,3%	24,9%	22,0%	48,7%
30.12.2019	bis	27.12.2021	36,2%	42,5%	43,7%	37,9%	38,1%	41,1%	35,7%	40,1%	38,4%	34,9%	54,5%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	21,5%	21,4%	-3,1%	17,7%	11,3%	26,9%	28,2%	16,0%	44,9%
27.12.2004	bis	28.12.2009	8,8%	12,6%	4,0%	26,5%	18,2%	22,7%	58,1%	40,8%	57,0%
28.12.2009	bis	29.12.2014	19,6%	17,1%	5,8%	19,8%	16,5%	20,3%	27,2%	22,6%	28,5%
29.12.2014	bis	30.12.2019	12,0%	11,1%	10,3%	19,5%	15,5%	17,3%	36,0%	26,3%	21,2%
30.12.2019	bis	27.12.2021	7,6%	5,4%	11,8%	24,9%	17,4%	26,3%	41,8%	31,0%	36,2%

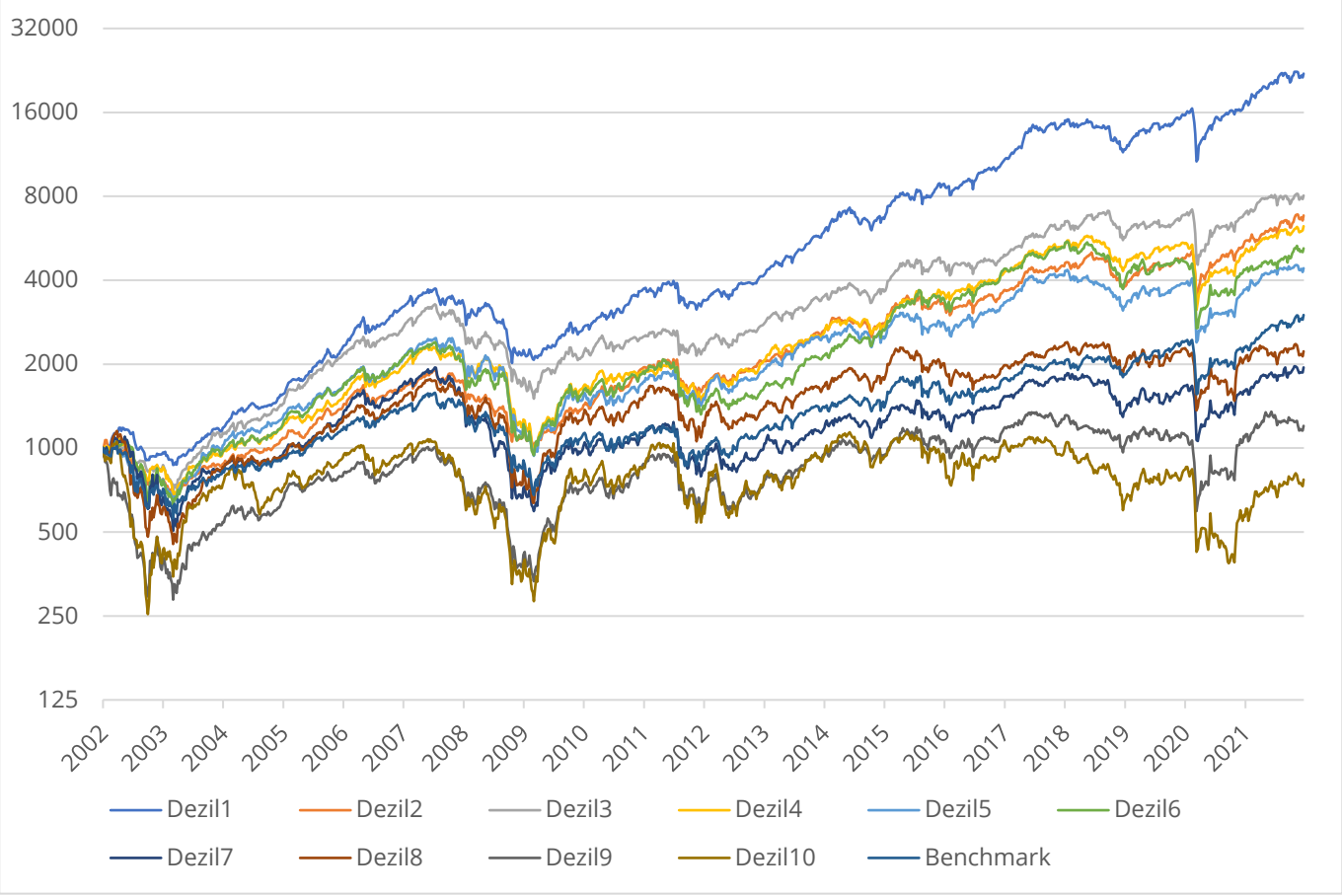
Kombi-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Frankreich
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	CAC40
Durchschnittliche Anzahl Aktien	176	Scoring-Modell:	Kombi-Score

Dezilanalyse

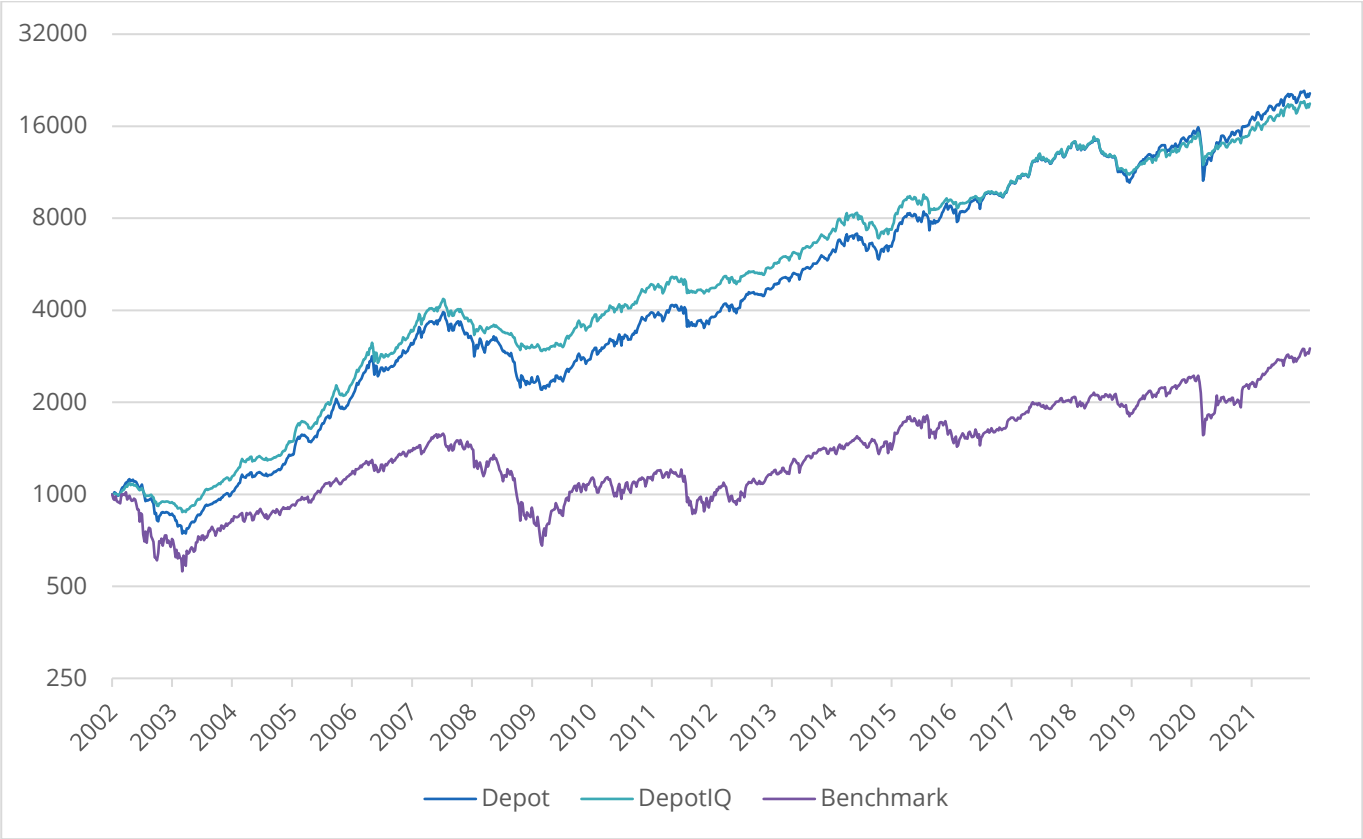
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	5,6%	16,7%	10,1%	11,0%	9,6%	7,7%	8,6%	3,4%	4,1%	0,9%	-1,3%
Annualisierte Volatilität	22,0%	16,6%	16,7%	17,4%	18,7%	20,2%	21,1%	23,8%	25,1%	27,1%	33,3%
Maximaler Drawdown	57,0%	46,0%	48,1%	54,2%	58,5%	62,2%	60,7%	69,5%	64,0%	71,4%	75,9%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,257	1,005	0,602	0,632	0,511	0,381	0,406	0,142	0,162	0,034	-0,039
Max 3 Jahre rollierend	118,9%	210,5%	133,9%	235,9%	161,3%	196,2%	187,1%	201,0%	204,2%	194,8%	250,3%
Min 3 Jahre rollierend	-45,7%	-23,9%	-37,9%	-35,8%	-44,5%	-48,7%	-47,6%	-60,6%	-52,8%	-60,5%	-71,1%
Max 5 Jahre rollierend	144,6%	299,5%	195,5%	274,6%	203,3%	275,5%	258,7%	196,6%	239,5%	202,2%	270,0%
Min 5 Jahre rollierend	-39,6%	-5,1%	-7,5%	-27,5%	-26,2%	-35,1%	-40,0%	-56,6%	-39,1%	-45,2%	-64,8%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	83,5%	70,6%	74,6%	72,6%	64,9%	64,1%	49,6%	47,2%	46,4%	32,7%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	16,3%	15,8%	5,6%
Annualisierte Volatilität	17,1%	13,7%	22,0%
Maximaler Drawdown	44,3%	32,4%	57,0%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,953	1,155	0,257
Max 3 Jahre rollierend	248,1%	240,1%	118,9%
Min 3 Jahre rollierend	-20,9%	-7,8%	-45,7%
Max 5 Jahre rollierend	347,4%	339,1%	144,6%
Min 5 Jahre rollierend	7,1%	18,2%	-39,6%
Anteil Outperformance 1 Jahr	80,2%	76,6%	---

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Kombi	70%
Verkaufskriterium 2	Kombi	70%
Depotumschlagsfaktor	1,21	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	18,4%	18,3%	-29,7%
30.12.2002	bis	29.12.2003	-4,5%	-3,2%	45,3%
29.12.2003	bis	27.12.2004	22,3%	17,1%	-3,6%
27.12.2004	bis	26.12.2005	25,2%	9,4%	-0,8%
26.12.2005	bis	25.12.2006	31,2%	10,8%	-10,4%
25.12.2006	bis	31.12.2007	2,0%	2,0%	-20,5%
31.12.2007	bis	29.12.2008	12,5%	5,1%	-12,0%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-12,5%	-7,2%	76,7%
28.12.2009	bis	27.12.2010	39,8%	37,5%	13,0%
27.12.2010	bis	26.12.2011	11,8%	3,5%	-14,5%
26.12.2011	bis	31.12.2012	2,7%	2,4%	2,5%
31.12.2012	bis	30.12.2013	8,1%	14,2%	5,2%
30.12.2013	bis	29.12.2014	2,3%	5,7%	-5,1%
29.12.2014	bis	28.12.2015	25,1%	14,8%	-1,3%
28.12.2015	bis	26.12.2016	9,0%	6,2%	-1,3%
26.12.2016	bis	25.12.2017	17,0%	16,0%	-13,3%
25.12.2017	bis	31.12.2018	-12,0%	-8,4%	-18,0%
31.12.2018	bis	30.12.2019	7,4%	-1,3%	-8,3%
30.12.2019	bis	28.12.2020	17,1%	15,2%	-12,1%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-8,0%	-2,8%	-9,7%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	-3,1%	15,8%	2,3%	12,5%	5,6%	8,3%	6,0%	-2,2%	-2,7%	-13,8%	-11,5%
27.12.2004	bis	28.12.2009	4,0%	11,3%	5,2%	8,4%	6,7%	3,2%	5,7%	1,0%	6,6%	2,3%	1,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	5,8%	20,3%	15,1%	11,7%	11,0%	11,0%	11,1%	4,9%	7,1%	5,5%	3,6%
29.12.2014	bis	30.12.2019	10,3%	18,4%	11,3%	13,0%	14,6%	9,1%	11,8%	5,9%	4,9%	3,7%	-1,8%
30.12.2019	bis	27.12.2021	11,8%	18,8%	19,3%	8,3%	7,2%	6,6%	5,5%	8,0%	-1,2%	3,1%	-3,9%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	26,9%	11,7%	14,5%	14,3%	16,9%	22,0%	21,9%	29,7%	32,2%	36,8%	42,9%
27.12.2004	bis	28.12.2009	22,7%	18,6%	17,2%	19,0%	22,7%	22,5%	23,4%	25,3%	26,3%	26,7%	31,5%
28.12.2009	bis	29.12.2014	20,3%	15,5%	16,5%	16,2%	16,7%	17,8%	18,9%	21,6%	21,6%	23,3%	30,8%
29.12.2014	bis	30.12.2019	17,3%	14,7%	14,6%	15,0%	13,8%	15,3%	16,6%	18,2%	18,2%	18,2%	24,2%
30.12.2019	bis	27.12.2021	26,3%	23,7%	23,1%	24,5%	25,1%	27,1%	28,6%	28,2%	32,6%	36,9%	45,3%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	44,9%	26,5%	36,8%	32,0%	39,1%	42,2%	41,9%	54,1%	60,7%	71,4%	75,9%
27.12.2004	bis	28.12.2009	57,0%	46,0%	48,1%	54,2%	58,5%	62,2%	60,7%	69,5%	64,0%	67,0%	73,8%
28.12.2009	bis	29.12.2014	28,5%	21,1%	24,2%	19,7%	26,6%	25,2%	36,8%	36,0%	36,9%	39,3%	48,3%
29.12.2014	bis	30.12.2019	21,2%	23,8%	25,9%	21,4%	25,5%	28,6%	32,5%	30,4%	29,3%	28,4%	47,6%
30.12.2019	bis	27.12.2021	36,2%	35,5%	33,1%	36,5%	42,4%	41,2%	42,5%	37,3%	40,1%	47,5%	54,9%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	10,2%	14,0%	-3,1%	12,4%	8,5%	26,9%	33,7%	19,5%	44,9%
27.12.2004	bis	28.12.2009	15,6%	19,0%	4,0%	18,4%	15,2%	22,7%	44,3%	32,4%	57,0%
28.12.2009	bis	29.12.2014	18,5%	15,7%	5,8%	16,1%	13,8%	20,3%	17,8%	17,6%	28,5%
29.12.2014	bis	30.12.2019	17,9%	14,0%	10,3%	15,9%	13,4%	17,3%	29,0%	25,0%	21,2%
30.12.2019	bis	27.12.2021	17,6%	15,4%	11,8%	23,8%	16,5%	26,3%	33,2%	21,6%	36,2%

Nordeuropa – StoxxNordic Total Market

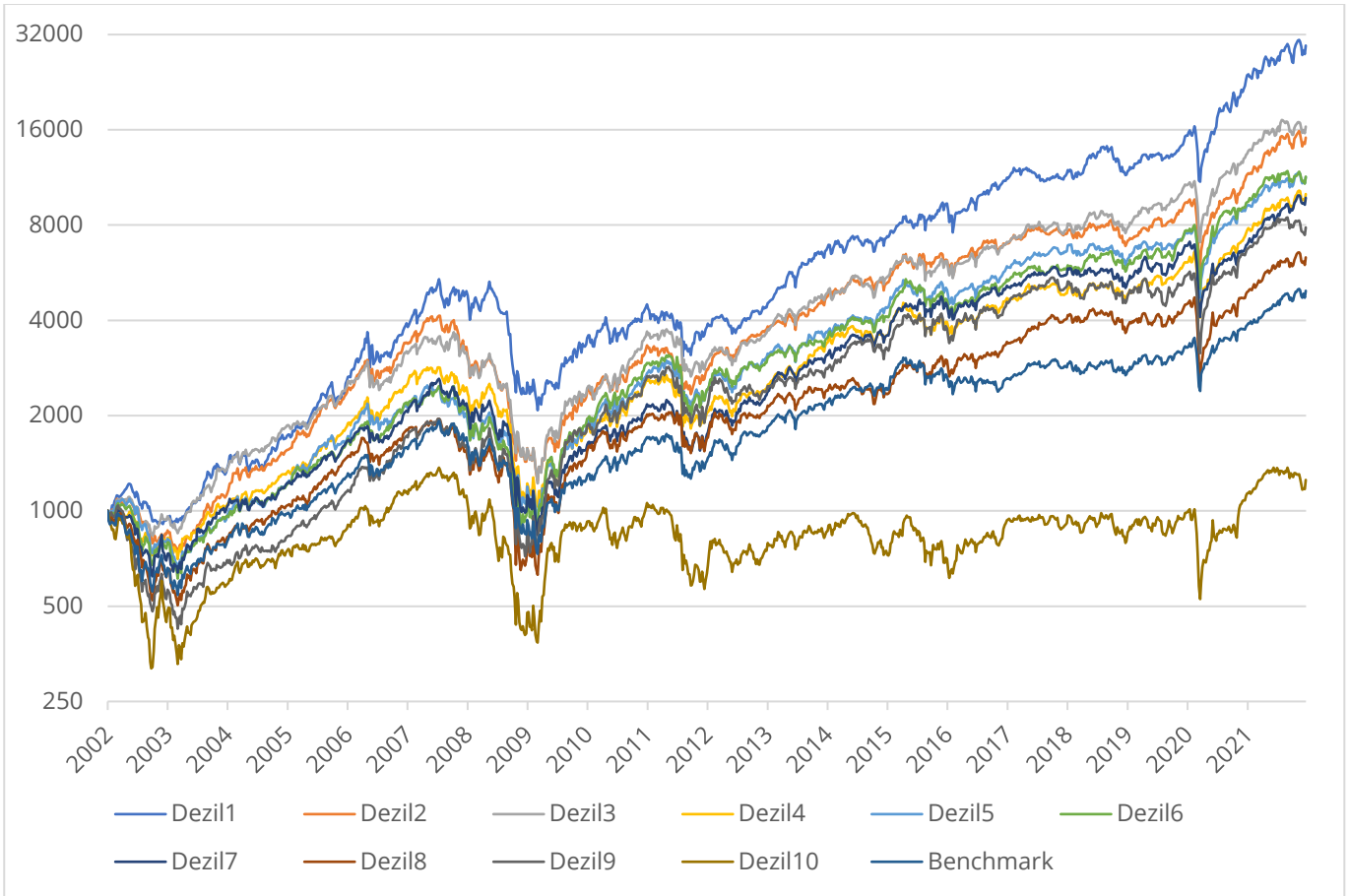
Trend-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Nordeuropa
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	FTSE Nordic30
Durchschnittliche Anzahl Aktien	193	Scoring-Modell:	Trend-Score

Dezilanalyse

	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	8,3%	18,4%	14,5%	15,0%	12,2%	12,9%	12,9%	12,0%	9,6%	10,8%	1,1%
Annualisierte Volatilität	22,2%	23,4%	22,2%	22,0%	22,1%	22,3%	24,1%	23,3%	25,3%	26,2%	30,7%
Maximaler Drawdown	62,0%	61,5%	70,0%	66,7%	63,7%	62,0%	63,9%	68,0%	67,8%	63,2%	72,0%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,375	0,787	0,654	0,679	0,552	0,578	0,535	0,517	0,381	0,415	0,037
Max 3 Jahre rollierend	152,5%	288,4%	269,4%	208,5%	178,9%	193,2%	205,0%	179,1%	216,0%	232,3%	200,3%
Min 3 Jahre rollierend	-47,2%	-34,1%	-53,5%	-53,4%	-48,4%	-50,6%	-48,5%	-53,0%	-59,5%	-41,9%	-60,3%
Max 5 Jahre rollierend	238,6%	444,1%	399,6%	322,0%	278,0%	302,7%	318,8%	288,9%	290,1%	286,2%	303,2%
Min 5 Jahre rollierend	-19,3%	-29,9%	-25,6%	-15,5%	-27,6%	-12,9%	-13,3%	-25,5%	-28,3%	-18,7%	-50,6%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	69,0%	71,0%	75,0%	62,5%	70,6%	66,1%	71,0%	53,2%	60,1%	32,7%

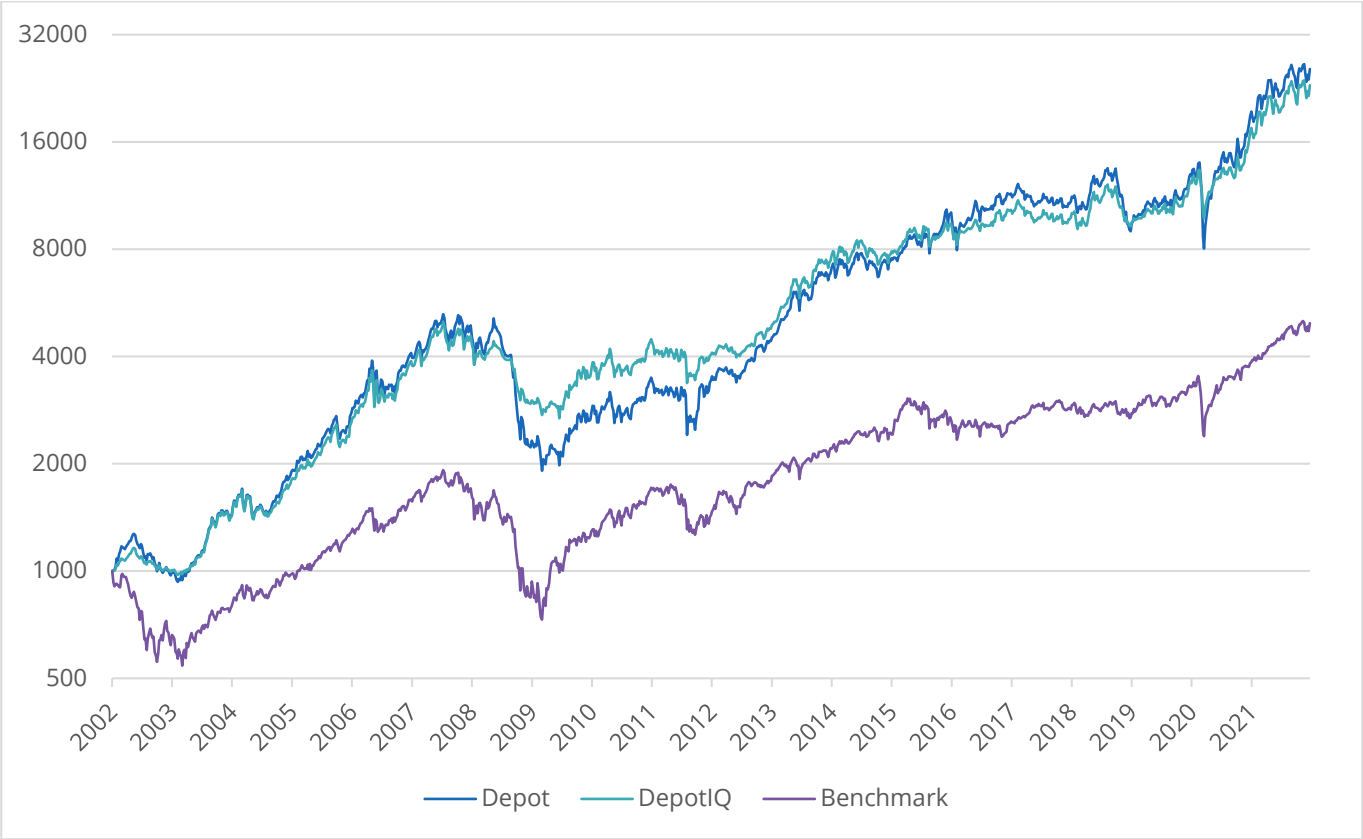


Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	17,6%	16,9%	8,3%
Annualisierte Volatilität	26,6%	21,5%	22,2%
Maximaler Drawdown	63,7%	46,2%	62,0%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,661	0,790	0,375

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Trend	70%
Verkaufskriterium 2	Trend	70%
Depotumschlagsfaktor	1,77	

Max 3 Jahre rollierend	275,4%	254,5%	152,5%
Min 3 Jahre rollierend	-48,7%	-27,2%	-47,2%
Max 5 Jahre rollierend	414,9%	374,7%	238,6%
Min 5 Jahre rollierend	-31,6%	-17,7%	-19,3%
Anteil Outperformance 1 Jahr	68,6%	69,8%	---



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	35,2%	27,0%	-13,3%
30.12.2002	bis	29.12.2003	19,8%	10,2%	3,6%
29.12.2003	bis	27.12.2004	6,1%	8,9%	-1,0%
27.12.2004	bis	26.12.2005	15,8%	19,2%	-2,0%
26.12.2005	bis	25.12.2006	24,8%	25,4%	16,3%
25.12.2006	bis	31.12.2007	12,9%	4,7%	-11,9%
31.12.2007	bis	29.12.2008	-3,9%	-3,9%	-8,0%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-29,0%	2,4%	80,6%
28.12.2009	bis	27.12.2010	-5,4%	1,7%	-4,8%
27.12.2010	bis	26.12.2011	14,2%	0,7%	-15,1%
26.12.2011	bis	31.12.2012	4,8%	1,2%	-5,6%
31.12.2012	bis	30.12.2013	31,1%	15,5%	-7,0%
30.12.2013	bis	29.12.2014	-2,4%	-1,0%	-9,1%
29.12.2014	bis	28.12.2015	25,4%	13,7%	-4,3%
28.12.2015	bis	26.12.2016	16,9%	18,6%	25,3%
26.12.2016	bis	25.12.2017	-15,7%	-4,6%	-3,3%
25.12.2017	bis	31.12.2018	-10,9%	2,7%	-4,6%
31.12.2018	bis	30.12.2019	23,0%	12,8%	0,2%
30.12.2019	bis	28.12.2020	28,8%	19,1%	-0,3%
28.12.2020	bis	27.12.2021	6,2%	0,5%	-13,9%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	-0,8%	19,4%	15,8%	22,7%	9,3%	6,5%	6,2%	6,5%	1,1%	-6,4%	-9,7%
27.12.2004	bis	28.12.2009	5,1%	14,6%	8,1%	4,9%	6,4%	8,3%	9,5%	5,3%	7,4%	16,6%	4,0%
28.12.2009	bis	29.12.2014	14,2%	16,6%	17,9%	18,4%	15,0%	19,5%	16,8%	17,9%	9,7%	13,0%	-3,6%
29.12.2014	bis	30.12.2019	6,1%	16,1%	12,6%	14,4%	11,2%	11,4%	13,3%	14,0%	13,8%	11,0%	5,7%
30.12.2019	bis	27.12.2021	22,9%	38,6%	26,5%	23,7%	28,2%	22,7%	21,5%	19,0%	18,6%	19,3%	12,7%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	25,4%	16,6%	17,1%	16,3%	17,9%	17,7%	21,5%	22,7%	23,0%	25,8%	36,9%
27.12.2004	bis	28.12.2009	27,3%	30,3%	28,9%	28,9%	28,5%	29,2%	32,6%	30,4%	34,5%	33,3%	35,8%
28.12.2009	bis	29.12.2014	19,4%	22,3%	19,9%	21,4%	21,0%	20,8%	21,7%	20,2%	20,9%	22,7%	26,4%
29.12.2014	bis	30.12.2019	16,5%	17,1%	16,5%	15,8%	15,9%	15,4%	16,0%	16,4%	16,6%	19,1%	22,6%
30.12.2019	bis	27.12.2021	22,1%	28,5%	27,1%	24,8%	25,2%	26,9%	25,8%	26,1%	29,6%	29,6%	34,9%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	45,7%	25,4%	32,7%	24,5%	29,6%	40,6%	42,3%	38,6%	49,7%	59,2%	68,2%
27.12.2004	bis	28.12.2009	62,0%	61,5%	70,0%	66,7%	63,7%	62,0%	63,9%	68,0%	67,8%	63,2%	72,0%
28.12.2009	bis	29.12.2014	27,7%	31,7%	30,2%	29,2%	32,2%	29,9%	35,5%	31,7%	25,8%	34,9%	46,6%
29.12.2014	bis	30.12.2019	23,5%	19,6%	17,4%	16,5%	21,4%	17,4%	24,4%	15,4%	16,2%	19,4%	36,4%
30.12.2019	bis	27.12.2021	32,1%	33,2%	39,4%	35,8%	38,0%	40,9%	37,2%	42,2%	45,7%	44,8%	48,1%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	23,1%	20,9%	-0,8%	18,1%	15,4%	25,4%	26,7%	17,2%	45,7%
27.12.2004	bis	28.12.2009	7,5%	14,9%	5,1%	30,5%	24,9%	27,3%	63,7%	46,2%	62,0%
28.12.2009	bis	29.12.2014	22,6%	16,9%	14,2%	25,3%	20,8%	19,4%	30,9%	24,7%	27,7%
29.12.2014	bis	30.12.2019	11,8%	9,8%	6,1%	22,5%	17,9%	16,5%	33,5%	23,7%	23,5%
30.12.2019	bis	27.12.2021	40,5%	36,5%	22,9%	37,4%	28,7%	22,1%	42,7%	26,9%	32,1%

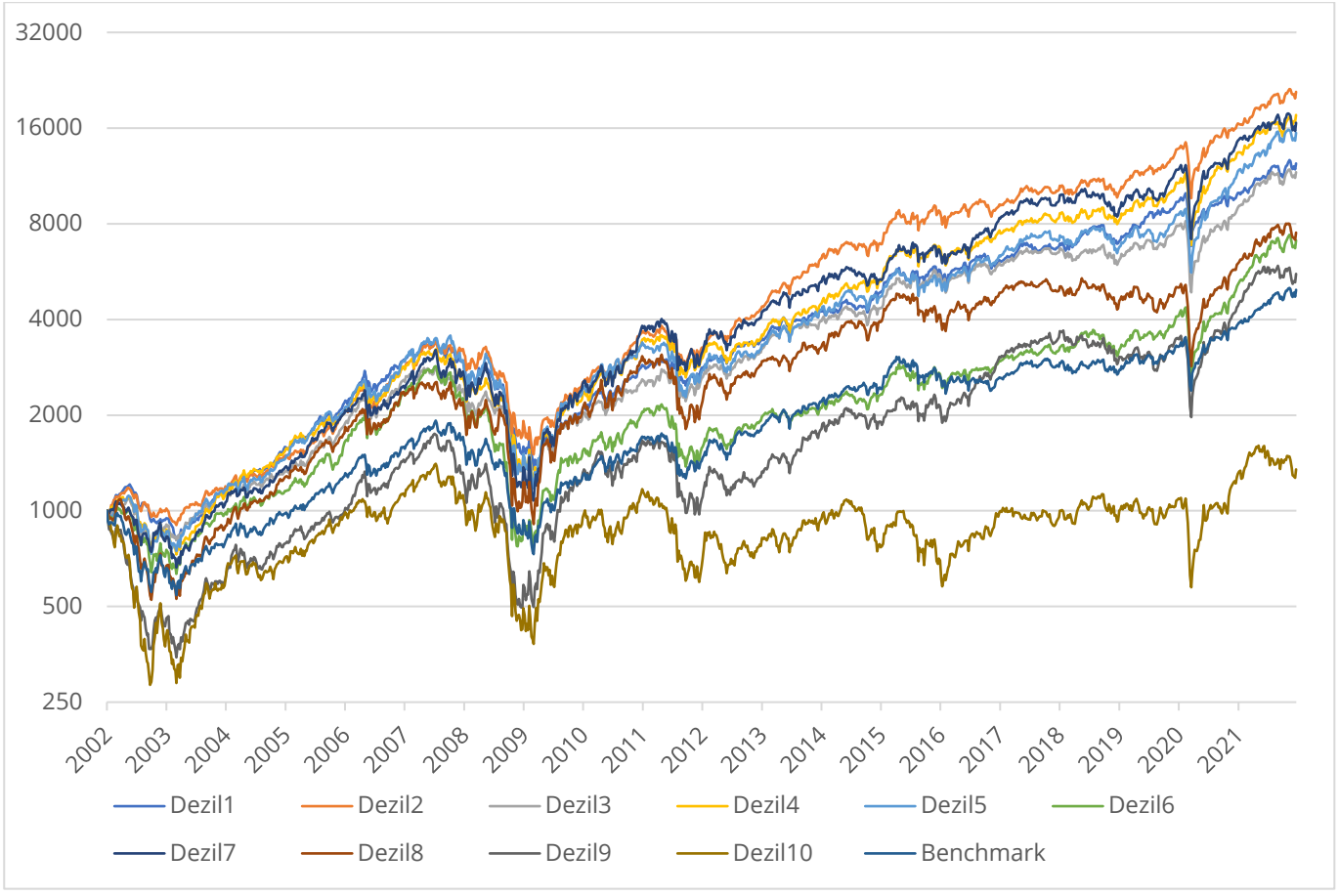
Safety-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Nordeuropa
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	FTSE Nordic30
Durchschnittliche Anzahl Aktien	193	Scoring-Modell:	Safety-Score

Dezilanalyse

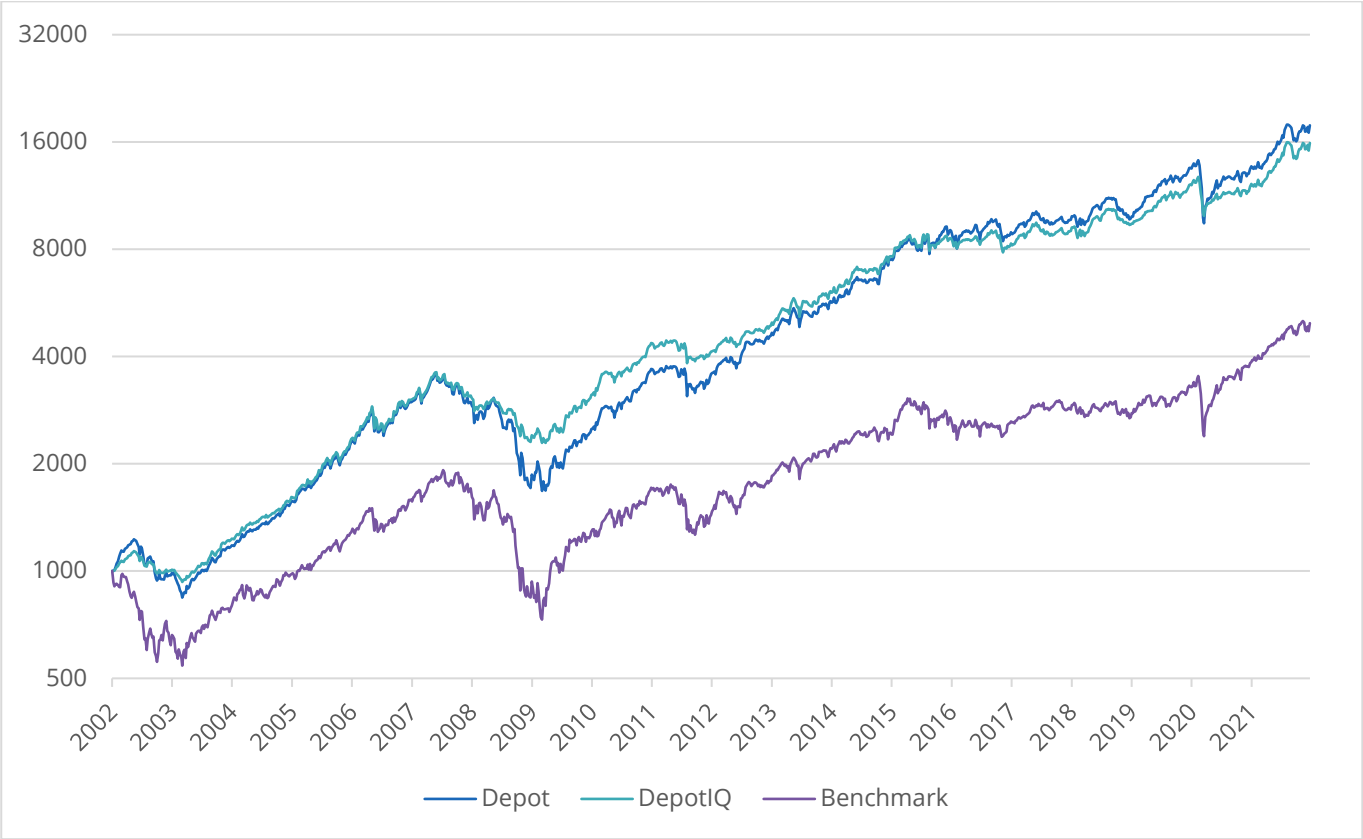
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	8,3%	13,4%	16,4%	13,0%	15,4%	14,7%	10,3%	15,1%	10,6%	9,0%	1,5%
Annualisierte Volatilität	22,2%	17,3%	19,0%	20,8%	21,7%	23,1%	24,2%	25,3%	27,0%	28,8%	32,8%
Maximaler Drawdown	62,0%	60,8%	55,7%	58,3%	62,1%	67,0%	72,9%	66,5%	64,3%	71,6%	72,9%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,375	0,772	0,861	0,626	0,709	0,634	0,425	0,595	0,392	0,311	0,046
Max 3 Jahre rollierend	152,5%	209,9%	166,0%	160,4%	211,6%	222,2%	183,2%	236,5%	268,9%	231,5%	256,7%
Min 3 Jahre rollierend	-47,2%	-44,7%	-32,9%	-42,6%	-47,4%	-50,9%	-57,2%	-50,5%	-52,7%	-56,7%	-62,9%
Max 5 Jahre rollierend	238,6%	251,6%	338,9%	243,4%	313,7%	376,0%	318,0%	415,1%	357,0%	351,3%	343,2%
Min 5 Jahre rollierend	-19,3%	-13,2%	4,2%	-5,5%	-6,0%	-21,3%	-42,9%	-7,5%	-38,1%	-35,2%	-51,6%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	67,7%	81,9%	65,3%	79,8%	70,2%	57,7%	72,6%	61,3%	54,8%	35,1%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	15,4%	14,8%	8,3%
Annualisierte Volatilität	17,6%	13,5%	22,2%
Maximaler Drawdown	52,9%	36,8%	62,0%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,878	1,100	0,375
Max 3 Jahre rollierend	200,0%	191,1%	152,5%
Min 3 Jahre rollierend	-35,6%	-15,2%	-47,2%
Max 5 Jahre rollierend	255,2%	246,3%	238,6%
Min 5 Jahre rollierend	7,3%	17,0%	-19,3%
Anteil Outperformance 1 Jahr	75,4%	69,4%	---

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Safety	80%
Verkaufskriterium 2	Safety	80%
Depotumschlagsfaktor	0,81	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	35,2%	34,7%	-21,6%
30.12.2002	bis	29.12.2003	-6,5%	-6,5%	20,0%
29.12.2003	bis	27.12.2004	8,0%	6,6%	1,1%
27.12.2004	bis	26.12.2005	15,3%	7,3%	0,7%
26.12.2005	bis	25.12.2006	7,7%	13,8%	7,5%
25.12.2006	bis	31.12.2007	-7,6%	-0,4%	-11,9%
31.12.2007	bis	29.12.2008	7,9%	2,6%	-11,7%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-5,6%	-9,0%	85,3%
28.12.2009	bis	27.12.2010	14,1%	7,5%	-7,9%
27.12.2010	bis	26.12.2011	11,7%	8,7%	-23,8%
26.12.2011	bis	31.12.2012	5,1%	3,8%	-3,6%
31.12.2012	bis	30.12.2013	1,5%	10,3%	6,8%
30.12.2013	bis	29.12.2014	20,1%	2,6%	-15,4%
29.12.2014	bis	28.12.2015	10,8%	12,1%	-8,7%
28.12.2015	bis	26.12.2016	0,4%	7,5%	40,4%
26.12.2016	bis	25.12.2017	-0,2%	1,7%	-3,1%
25.12.2017	bis	31.12.2018	6,8%	6,0%	-2,3%
31.12.2018	bis	30.12.2019	17,1%	15,4%	-3,7%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-17,3%	-4,5%	4,9%
28.12.2020	bis	27.12.2021	3,1%	-3,1%	-13,0%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	-0,8%	16,1%	14,0%	9,7%	15,2%	13,2%	4,4%	10,6%	8,0%	-7,9%	-11,4%
27.12.2004	bis	28.12.2009	5,1%	5,6%	10,8%	7,9%	8,0%	10,0%	5,4%	12,3%	9,8%	10,0%	5,4%
28.12.2009	bis	29.12.2014	14,2%	18,7%	22,9%	17,6%	18,6%	15,0%	9,3%	17,2%	14,3%	8,6%	-2,8%
29.12.2014	bis	30.12.2019	6,1%	14,0%	14,6%	12,7%	15,3%	12,7%	12,1%	17,2%	5,0%	12,8%	6,7%
30.12.2019	bis	27.12.2021	22,9%	15,0%	23,1%	21,4%	27,8%	34,6%	31,7%	18,5%	21,9%	26,3%	11,6%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	25,4%	12,1%	12,9%	15,8%	17,4%	19,5%	20,8%	20,3%	25,5%	30,2%	40,5%
27.12.2004	bis	28.12.2009	27,3%	21,8%	24,6%	27,3%	28,5%	30,9%	32,3%	34,6%	35,3%	36,7%	37,8%
28.12.2009	bis	29.12.2014	19,4%	15,3%	17,7%	18,0%	19,5%	20,7%	21,5%	22,9%	25,1%	26,4%	28,7%
29.12.2014	bis	30.12.2019	16,5%	14,8%	15,1%	15,8%	15,3%	16,2%	15,9%	17,0%	17,9%	18,8%	24,2%
30.12.2019	bis	27.12.2021	22,1%	21,8%	22,6%	26,1%	26,5%	25,9%	28,6%	28,1%	29,1%	30,9%	35,6%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	45,7%	33,2%	23,7%	29,6%	34,5%	34,4%	38,4%	38,2%	51,8%	65,4%	71,6%
27.12.2004	bis	28.12.2009	62,0%	60,8%	55,7%	58,3%	62,1%	67,0%	72,9%	66,5%	64,3%	71,6%	72,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	27,7%	19,4%	25,6%	21,7%	26,3%	32,7%	36,4%	31,3%	41,7%	41,8%	49,0%
29.12.2014	bis	30.12.2019	23,5%	13,3%	14,7%	15,2%	14,0%	17,8%	18,1%	18,3%	23,7%	25,2%	42,1%
30.12.2019	bis	27.12.2021	32,1%	31,8%	33,3%	40,4%	40,6%	37,0%	42,9%	41,5%	45,0%	44,5%	47,7%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	15,8%	16,7%	-0,8%	12,9%	8,3%	25,4%	31,4%	18,1%	45,7%
27.12.2004	bis	28.12.2009	9,6%	14,0%	5,1%	22,2%	16,3%	27,3%	52,9%	36,8%	62,0%
28.12.2009	bis	29.12.2014	24,9%	20,0%	14,2%	15,3%	12,7%	19,4%	17,7%	13,7%	27,7%
29.12.2014	bis	30.12.2019	12,5%	9,7%	6,1%	14,6%	12,3%	16,5%	13,3%	13,3%	23,5%
30.12.2019	bis	27.12.2021	14,8%	14,4%	22,9%	22,5%	16,2%	22,1%	33,5%	22,2%	32,1%

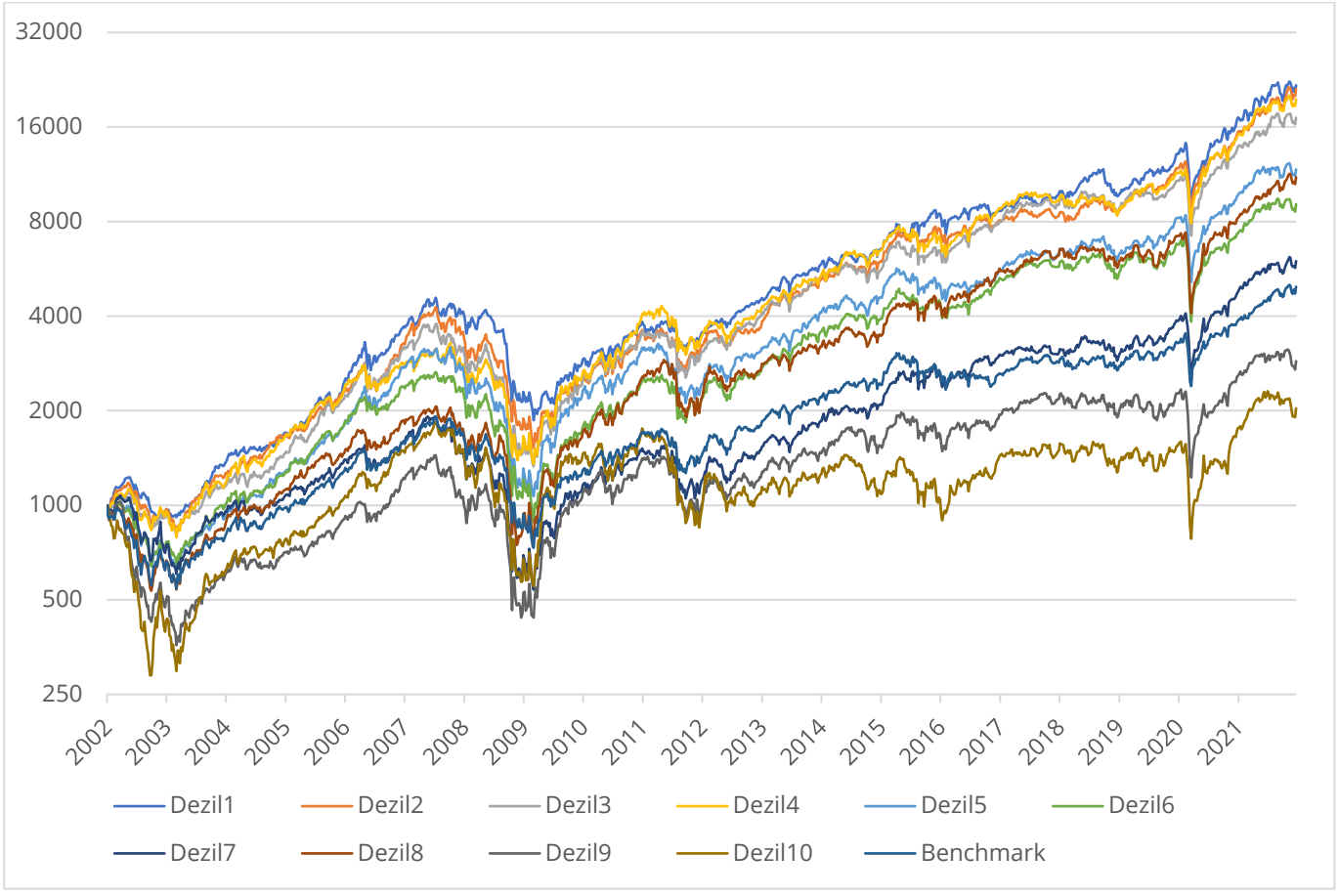
Technischer Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Nordeuropa
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	FTSE Nordic30
Durchschnittliche Anzahl Aktien	193	Scoring-Modell:	Technischer Score

Dezilanalyse

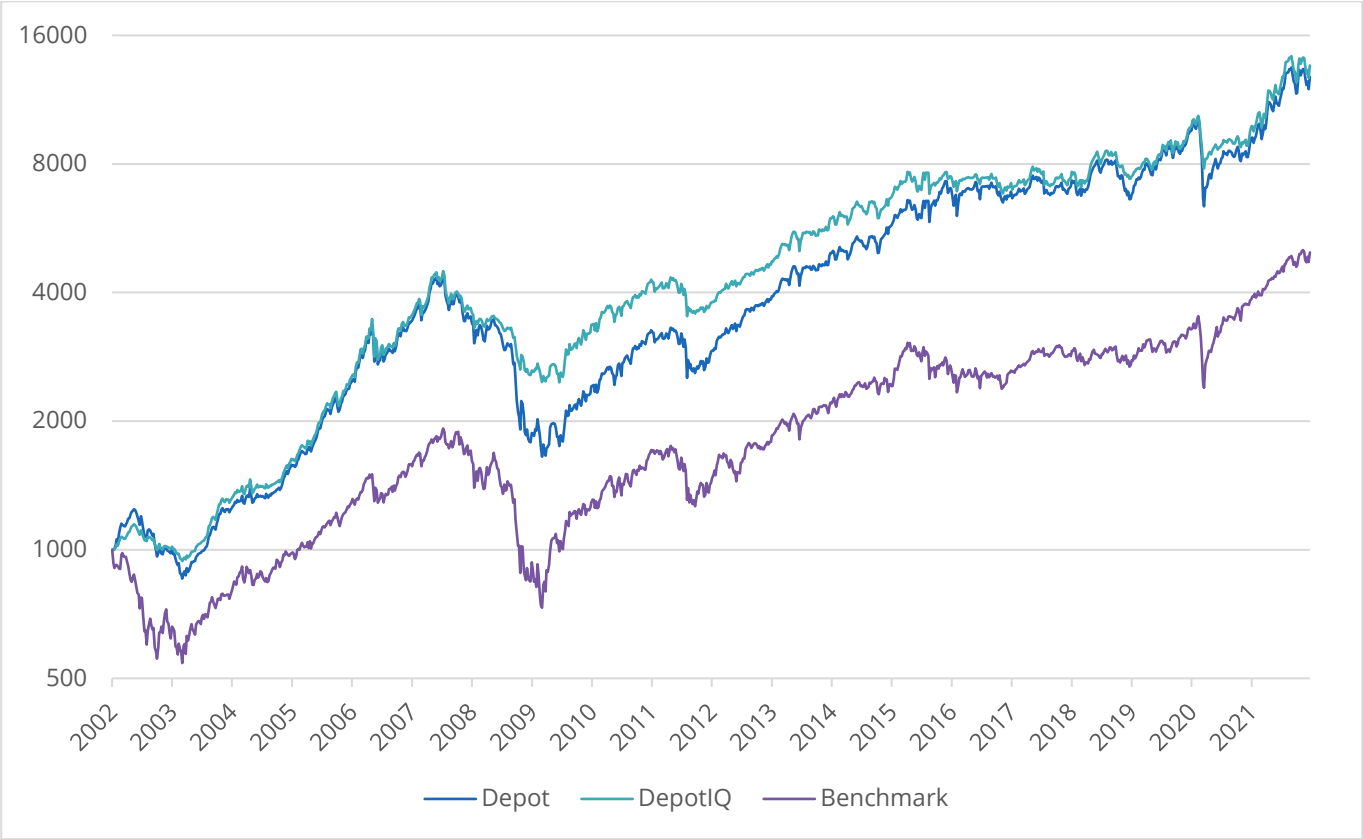
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	8,3%	16,6%	16,4%	15,2%	16,0%	13,1%	11,6%	9,3%	12,8%	5,4%	3,6%
Annualisierte Volatilität	22,2%	19,8%	21,3%	21,8%	22,3%	22,8%	23,5%	24,7%	25,0%	28,2%	32,0%
Maximaler Drawdown	62,0%	59,3%	64,4%	64,8%	58,8%	66,4%	66,7%	71,9%	63,7%	69,6%	71,3%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,375	0,839	0,773	0,699	0,718	0,573	0,496	0,378	0,510	0,192	0,113
Max 3 Jahre rollierend	152,5%	232,2%	205,1%	222,0%	218,1%	226,6%	216,1%	159,0%	238,3%	175,9%	290,9%
Min 3 Jahre rollierend	-47,2%	-36,5%	-40,1%	-45,8%	-45,9%	-47,6%	-55,2%	-63,0%	-53,0%	-55,3%	-53,1%
Max 5 Jahre rollierend	238,6%	372,6%	349,9%	316,7%	309,9%	371,2%	315,1%	267,8%	325,0%	256,7%	504,4%
Min 5 Jahre rollierend	-19,3%	-16,2%	-21,5%	-14,0%	1,8%	-18,1%	-16,3%	-46,5%	-19,0%	-34,8%	-46,2%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	78,6%	79,8%	72,2%	73,0%	71,8%	66,9%	50,4%	60,5%	42,7%	41,1%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	13,6%	13,9%	8,3%
Annualisierte Volatilität	20,2%	16,2%	22,2%
Maximaler Drawdown	62,2%	45,1%	62,0%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,669	0,856	0,375
Max 3 Jahre rollierend	261,5%	250,6%	152,5%
Min 3 Jahre rollierend	-45,9%	-22,7%	-47,2%
Max 5 Jahre rollierend	308,9%	326,9%	238,6%
Min 5 Jahre rollierend	-23,3%	-5,3%	-19,3%
Anteil Outperformance 1 Jahr	63,3%	62,5%	---

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Technisch	70%
Verkaufskriterium 2	Technisch	70%
Depotumschlagsfaktor	1,52	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	36,2%	32,6%	-18,5%
30.12.2002	bis	29.12.2003	-0,5%	9,8%	12,5%
29.12.2003	bis	27.12.2004	1,5%	5,3%	-2,2%
27.12.2004	bis	26.12.2005	25,7%	9,7%	2,0%
26.12.2005	bis	25.12.2006	15,1%	23,5%	14,1%
25.12.2006	bis	31.12.2007	-4,3%	3,3%	-13,0%
31.12.2007	bis	29.12.2008	1,4%	0,8%	-9,2%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-18,9%	-13,6%	89,6%
28.12.2009	bis	27.12.2010	4,7%	5,6%	-9,1%
27.12.2010	bis	26.12.2011	3,7%	6,2%	-21,8%
26.12.2011	bis	31.12.2012	9,8%	-2,1%	-3,1%
31.12.2012	bis	30.12.2013	4,8%	11,9%	-5,9%
30.12.2013	bis	29.12.2014	4,7%	2,0%	-13,2%
29.12.2014	bis	28.12.2015	12,8%	19,0%	-8,3%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-0,4%	6,9%	25,0%
26.12.2016	bis	25.12.2017	-6,1%	-2,2%	0,2%
25.12.2017	bis	31.12.2018	0,1%	7,0%	-6,2%
31.12.2018	bis	30.12.2019	22,4%	16,1%	-2,4%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-22,7%	11,1%	-4,5%
28.12.2020	bis	27.12.2021	13,2%	4,9%	-14,4%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	-0,8%	19,2%	18,5%	13,1%	17,7%	8,2%	7,6%	1,8%	3,7%	-11,0%	-8,8%
27.12.2004	bis	28.12.2009	5,1%	10,8%	7,8%	11,0%	9,4%	11,8%	6,6%	1,1%	8,1%	8,3%	12,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	14,2%	18,1%	19,6%	17,9%	20,4%	15,6%	17,8%	13,3%	16,2%	8,1%	-4,3%
29.12.2014	bis	30.12.2019	6,1%	15,2%	14,7%	14,1%	12,0%	12,3%	11,7%	13,0%	15,5%	7,9%	6,7%
30.12.2019	bis	27.12.2021	22,9%	28,3%	33,7%	25,9%	31,0%	19,5%	15,7%	24,5%	24,1%	12,6%	14,7%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	25,4%	12,5%	14,9%	16,3%	19,6%	18,7%	20,3%	23,3%	22,2%	29,9%	37,8%
27.12.2004	bis	28.12.2009	27,3%	25,4%	27,6%	29,5%	29,0%	30,2%	30,0%	33,8%	32,4%	36,8%	37,1%
28.12.2009	bis	29.12.2014	19,4%	17,0%	20,2%	19,7%	21,0%	21,4%	21,7%	21,5%	22,6%	23,2%	27,9%
29.12.2014	bis	30.12.2019	16,5%	15,8%	16,0%	15,5%	16,1%	16,1%	16,2%	15,7%	17,9%	19,2%	23,6%
30.12.2019	bis	27.12.2021	22,1%	27,2%	25,3%	24,7%	23,6%	25,2%	28,8%	26,0%	29,1%	31,2%	36,8%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	45,7%	25,6%	29,1%	27,3%	29,8%	39,6%	36,8%	43,6%	46,6%	65,1%	71,3%
27.12.2004	bis	28.12.2009	62,0%	59,3%	64,4%	64,8%	58,8%	66,4%	66,7%	71,9%	63,7%	69,6%	70,0%
28.12.2009	bis	29.12.2014	27,7%	20,5%	27,8%	28,9%	30,0%	35,3%	29,4%	32,0%	34,1%	35,8%	51,7%
29.12.2014	bis	30.12.2019	23,5%	18,1%	15,7%	15,4%	19,9%	21,4%	19,7%	16,6%	14,9%	24,7%	37,1%
30.12.2019	bis	27.12.2021	32,1%	36,4%	33,8%	36,4%	32,6%	38,8%	45,8%	38,5%	44,8%	47,6%	51,0%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	16,1%	17,3%	-0,8%	14,0%	10,1%	25,4%	31,3%	18,1%	45,7%
27.12.2004	bis	28.12.2009	8,2%	14,9%	5,1%	24,7%	19,5%	27,3%	62,2%	45,1%	62,0%
28.12.2009	bis	29.12.2014	19,6%	15,5%	14,2%	17,6%	14,5%	19,4%	23,6%	18,9%	27,7%
29.12.2014	bis	30.12.2019	10,8%	8,0%	6,1%	17,3%	14,5%	16,5%	19,3%	14,0%	23,5%
30.12.2019	bis	27.12.2021	15,8%	18,1%	22,9%	27,7%	22,1%	22,1%	37,3%	24,8%	32,1%

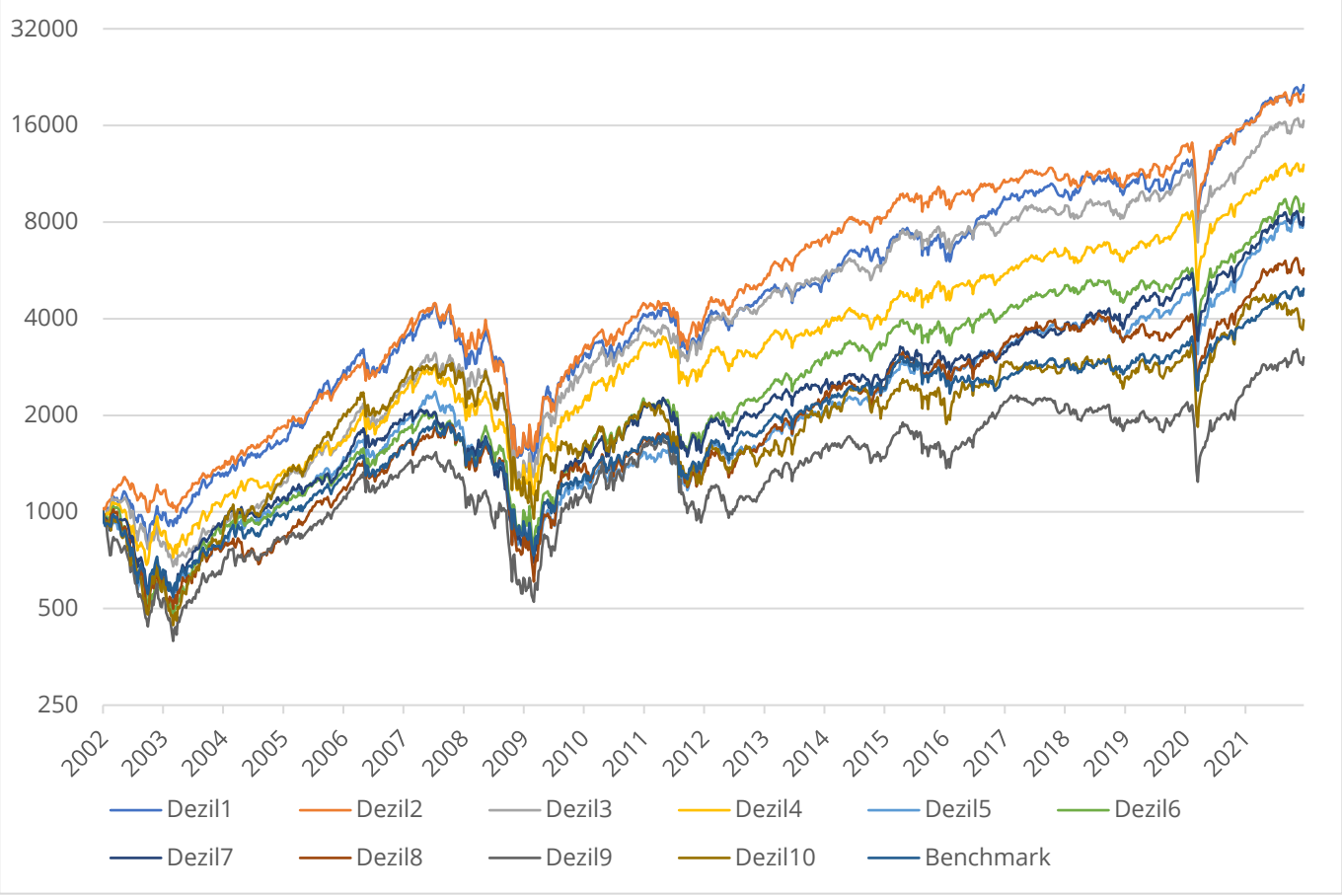
Value-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Nordeuropa
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	FTSE Nordic30
Durchschnittliche Anzahl Aktien	191	Scoring-Modell:	Value-Score

Dezilanalyse

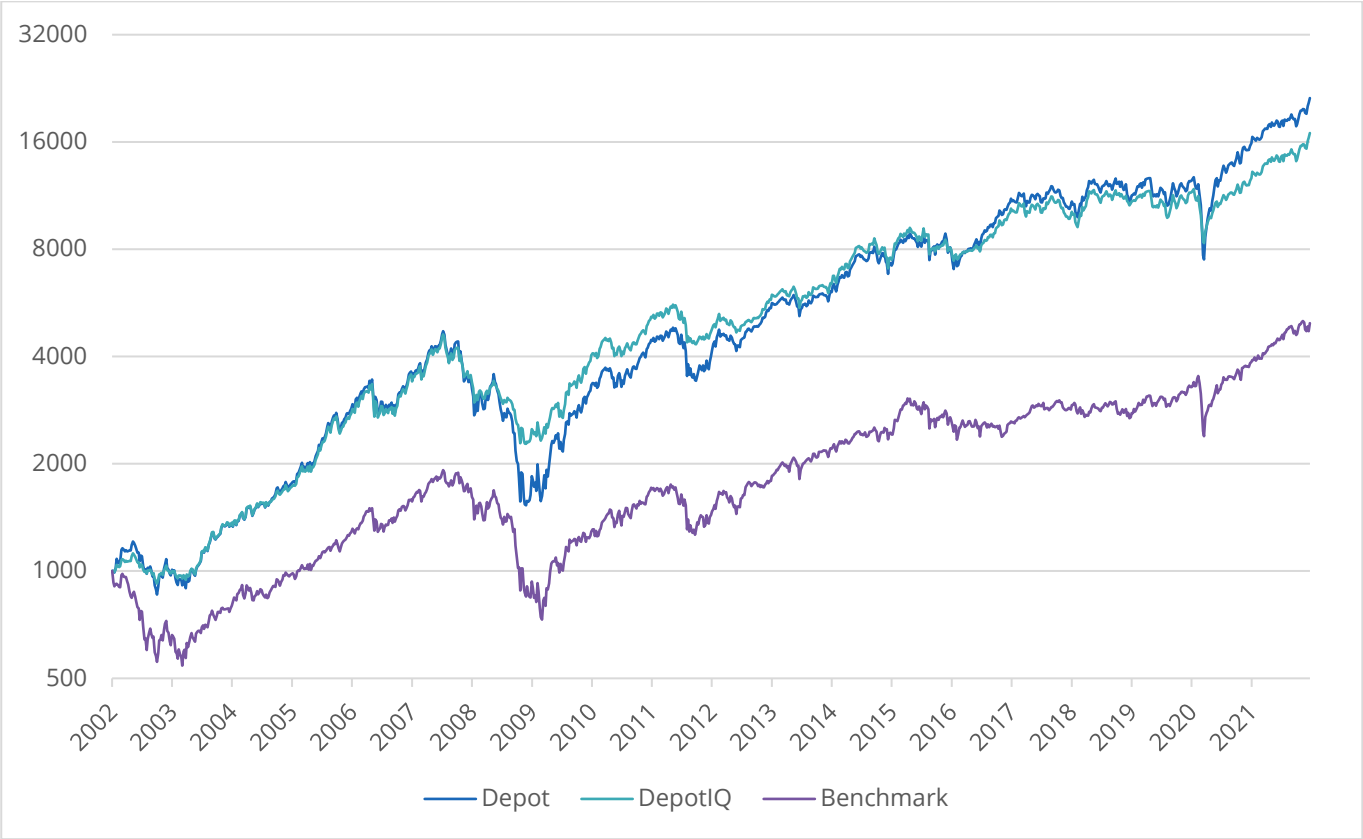
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	8,3%	16,5%	16,1%	15,0%	13,2%	11,0%	11,7%	11,1%	9,1%	5,7%	7,1%
Annualisierte Volatilität	22,2%	23,9%	23,0%	23,0%	23,5%	22,3%	23,0%	23,1%	24,3%	25,2%	28,3%
Maximaler Drawdown	62,0%	67,6%	66,7%	60,4%	59,8%	70,7%	62,0%	66,7%	67,9%	65,8%	67,3%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,375	0,691	0,700	0,654	0,564	0,491	0,508	0,482	0,374	0,226	0,252
Max 3 Jahre rollierend	152,5%	229,4%	194,5%	209,0%	180,6%	190,4%	215,4%	195,1%	167,3%	198,3%	379,4%
Min 3 Jahre rollierend	-47,2%	-51,1%	-43,5%	-33,3%	-36,8%	-55,1%	-47,7%	-57,5%	-53,8%	-56,5%	-55,8%
Max 5 Jahre rollierend	238,6%	422,8%	382,3%	341,7%	279,8%	291,0%	306,5%	254,4%	302,7%	222,1%	496,5%
Min 5 Jahre rollierend	-19,3%	-10,8%	-13,4%	-2,4%	-1,7%	-37,2%	-15,3%	-29,3%	-24,6%	-35,0%	-52,6%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	70,2%	75,8%	73,0%	64,1%	64,1%	65,3%	58,5%	55,7%	44,8%	47,6%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	16,5%	15,2%	8,3%
Annualisierte Volatilität	24,5%	18,4%	22,2%
Maximaler Drawdown	67,5%	50,7%	62,0%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,672	0,822	0,375
Max 3 Jahre rollierend	266,8%	237,3%	152,5%
Min 3 Jahre rollierend	-50,8%	-25,0%	-47,2%
Max 5 Jahre rollierend	409,6%	364,4%	238,6%
Min 5 Jahre rollierend	-11,2%	-4,9%	-19,3%
Anteil Outperformance 1 Jahr	71,4%	60,1%	---

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Value	90%
Verkaufskriterium 2	Value	90%
Depotumschlagsfaktor	1,16	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	35,3%	42,0%	-8,6%
30.12.2002	bis	29.12.2003	11,9%	2,9%	10,9%
29.12.2003	bis	27.12.2004	5,4%	5,8%	14,3%
27.12.2004	bis	26.12.2005	29,9%	19,5%	13,2%
26.12.2005	bis	25.12.2006	4,2%	9,5%	3,5%
25.12.2006	bis	31.12.2007	-11,7%	-7,6%	-6,7%
31.12.2007	bis	29.12.2008	-2,3%	-5,0%	-6,9%
29.12.2008	bis	28.12.2009	47,7%	48,0%	22,2%
28.12.2009	bis	27.12.2010	2,0%	3,8%	3,7%
27.12.2010	bis	26.12.2011	4,3%	3,3%	-23,2%
26.12.2011	bis	31.12.2012	15,3%	9,2%	-7,4%
31.12.2012	bis	30.12.2013	-12,2%	-0,6%	10,3%
30.12.2013	bis	29.12.2014	9,4%	6,7%	-10,5%
29.12.2014	bis	28.12.2015	0,5%	5,5%	-5,5%
28.12.2015	bis	26.12.2016	37,1%	25,2%	36,4%
26.12.2016	bis	25.12.2017	-14,2%	-7,9%	-12,9%
25.12.2017	bis	31.12.2018	11,8%	4,6%	-6,1%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-8,9%	7,1%	-1,0%
30.12.2019	bis	28.12.2020	9,0%	7,1%	10,0%
28.12.2020	bis	27.12.2021	6,7%	-0,5%	-20,4%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	-0,8%	18,4%	22,6%	6,6%	9,8%	2,7%	1,7%	2,8%	-6,3%	-6,3%	7,6%
27.12.2004	bis	28.12.2009	5,1%	12,4%	11,2%	17,5%	10,2%	2,1%	6,9%	6,0%	10,4%	6,7%	4,6%
28.12.2009	bis	29.12.2014	14,2%	15,8%	21,3%	16,7%	13,1%	14,6%	17,7%	12,1%	12,5%	5,4%	6,4%
29.12.2014	bis	30.12.2019	6,1%	14,4%	10,9%	13,6%	16,0%	14,8%	10,9%	15,6%	10,0%	7,5%	7,5%
30.12.2019	bis	27.12.2021	22,9%	32,5%	20,2%	21,7%	19,9%	30,0%	27,5%	24,4%	20,7%	19,3%	13,7%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	25,4%	19,1%	15,4%	20,8%	21,6%	21,6%	22,3%	21,7%	25,6%	26,3%	29,7%
27.12.2004	bis	28.12.2009	27,3%	33,1%	32,0%	30,5%	30,7%	28,0%	29,7%	28,6%	30,4%	30,4%	34,0%
28.12.2009	bis	29.12.2014	19,4%	20,2%	20,3%	19,5%	20,2%	20,7%	20,7%	21,6%	21,9%	24,3%	26,5%
29.12.2014	bis	30.12.2019	16,5%	17,8%	15,6%	16,3%	15,8%	15,3%	15,9%	16,6%	16,8%	17,8%	20,4%
30.12.2019	bis	27.12.2021	22,1%	25,2%	27,5%	26,6%	28,7%	26,1%	25,2%	27,1%	27,3%	27,6%	31,7%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	45,7%	30,1%	22,1%	39,2%	36,1%	46,7%	55,6%	45,1%	51,1%	60,4%	55,7%
27.12.2004	bis	28.12.2009	62,0%	67,6%	66,7%	60,4%	59,8%	70,7%	62,0%	66,7%	67,9%	65,8%	67,3%
28.12.2009	bis	29.12.2014	27,7%	28,1%	29,3%	24,2%	29,9%	25,2%	32,9%	34,4%	32,3%	45,5%	45,0%
29.12.2014	bis	30.12.2019	23,5%	21,6%	14,8%	16,9%	13,0%	17,6%	16,7%	16,9%	19,1%	28,0%	27,6%
30.12.2019	bis	27.12.2021	32,1%	37,0%	42,4%	41,1%	43,4%	37,6%	37,0%	38,5%	40,1%	43,5%	44,5%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	20,7%	19,8%	-0,8%	19,4%	13,7%	25,4%	29,0%	17,7%	45,7%
27.12.2004	bis	28.12.2009	12,8%	17,8%	5,1%	33,6%	24,2%	27,3%	67,5%	50,7%	62,0%
28.12.2009	bis	29.12.2014	17,8%	14,2%	14,2%	19,7%	16,2%	19,4%	29,0%	22,7%	27,7%
29.12.2014	bis	30.12.2019	11,1%	8,7%	6,1%	19,1%	16,1%	16,5%	20,5%	19,1%	23,5%
30.12.2019	bis	27.12.2021	30,8%	21,4%	22,9%	27,5%	18,7%	22,1%	41,2%	29,5%	32,1%

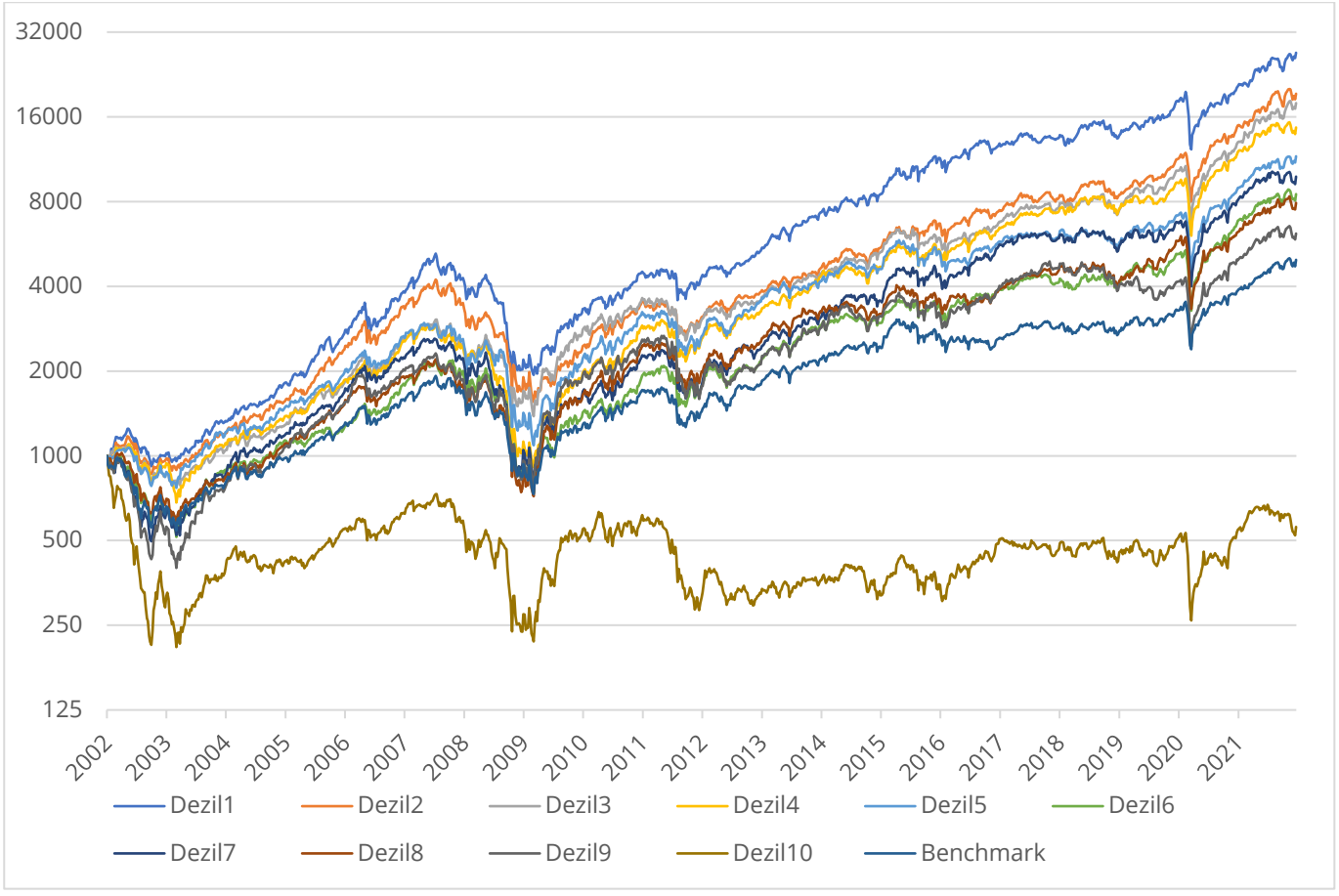
Kombi-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Nordeuropa
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	FTSE Nordic30
Durchschnittliche Anzahl Aktien	190	Scoring-Modell:	Kombi-Score

Dezilanalyse

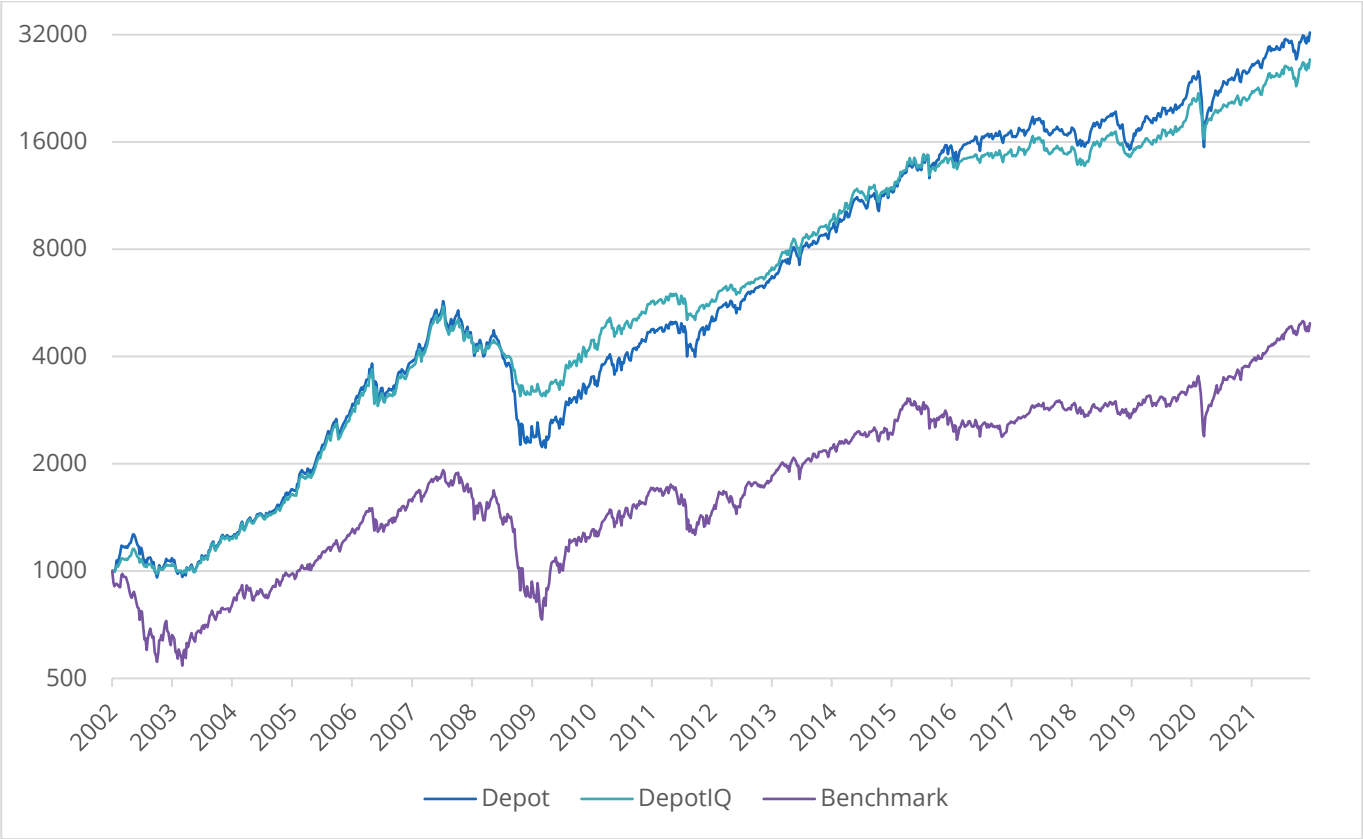
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	8,3%	17,9%	15,9%	15,5%	14,4%	13,0%	11,3%	12,1%	10,9%	9,5%	-2,9%
Annualisierte Volatilität	22,2%	20,8%	20,8%	21,6%	21,8%	22,7%	24,3%	24,7%	25,1%	26,8%	32,4%
Maximaler Drawdown	62,0%	62,9%	63,2%	54,6%	68,5%	63,3%	66,1%	68,5%	67,4%	65,8%	79,1%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,375	0,861	0,765	0,716	0,657	0,572	0,465	0,488	0,433	0,355	-0,088
Max 3 Jahre rollierend	152,5%	250,1%	211,3%	172,4%	218,2%	181,6%	176,4%	273,2%	219,3%	351,5%	176,1%
Min 3 Jahre rollierend	-47,2%	-40,0%	-41,5%	-31,7%	-52,7%	-49,8%	-45,3%	-56,2%	-57,5%	-57,1%	-61,6%
Max 5 Jahre rollierend	238,6%	421,7%	368,3%	258,7%	387,2%	304,0%	303,2%	397,9%	363,7%	388,0%	223,7%
Min 5 Jahre rollierend	-19,3%	-11,5%	-19,2%	6,8%	-19,7%	-19,9%	-19,1%	-26,5%	-21,6%	-31,1%	-57,7%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	79,4%	74,2%	76,2%	72,2%	65,3%	64,9%	70,2%	60,1%	57,3%	25,8%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	19,0%	17,9%	8,3%
Annualisierte Volatilität	21,5%	17,0%	22,2%
Maximaler Drawdown	61,2%	44,2%	62,0%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,882	1,056	0,375
Max 3 Jahre rollierend	304,9%	295,6%	152,5%
Min 3 Jahre rollierend	-35,5%	-13,3%	-47,2%
Max 5 Jahre rollierend	443,0%	438,2%	238,6%
Min 5 Jahre rollierend	0,0%	12,7%	-19,3%
Anteil Outperformance 1 Jahr	76,2%	73,4%	---

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Kombi	70%
Verkaufskriterium 2	Kombi	70%
Depotumschlagsfaktor	1,05	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	44,4%	35,8%	-21,2%
30.12.2002	bis	29.12.2003	-9,5%	1,8%	11,5%
29.12.2003	bis	27.12.2004	9,9%	8,8%	-0,1%
27.12.2004	bis	26.12.2005	37,7%	20,1%	7,0%
26.12.2005	bis	25.12.2006	12,2%	18,3%	-1,2%
25.12.2006	bis	31.12.2007	13,9%	0,1%	-14,3%
31.12.2007	bis	29.12.2008	-0,4%	-1,2%	-6,9%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-1,2%	-0,4%	73,3%
28.12.2009	bis	27.12.2010	4,1%	7,8%	-10,0%
27.12.2010	bis	26.12.2011	21,2%	7,1%	-25,3%
26.12.2011	bis	31.12.2012	7,5%	0,3%	-9,8%
31.12.2012	bis	30.12.2013	14,4%	5,4%	-0,6%
30.12.2013	bis	29.12.2014	17,4%	6,2%	-9,9%
29.12.2014	bis	28.12.2015	23,0%	18,4%	-5,8%
28.12.2015	bis	26.12.2016	12,9%	13,7%	33,3%
26.12.2016	bis	25.12.2017	-10,6%	-1,7%	-3,3%
25.12.2017	bis	31.12.2018	-3,7%	6,9%	-6,4%
31.12.2018	bis	30.12.2019	32,1%	14,4%	-8,1%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-7,3%	4,1%	-3,9%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-3,4%	2,7%	-15,4%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	-0,8%	21,8%	15,9%	8,5%	10,8%	13,6%	4,0%	5,5%	2,8%	2,1%	-25,5%
27.12.2004	bis	28.12.2009	5,1%	12,2%	8,9%	16,0%	6,9%	7,9%	4,0%	6,6%	7,8%	11,7%	4,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	14,2%	21,3%	18,1%	14,3%	19,8%	16,5%	16,6%	17,0%	15,0%	11,0%	-8,9%
29.12.2014	bis	30.12.2019	6,1%	16,5%	15,6%	14,4%	14,8%	9,1%	11,9%	13,6%	12,6%	5,9%	8,9%
30.12.2019	bis	27.12.2021	22,9%	21,8%	30,6%	31,8%	25,3%	27,3%	27,9%	20,5%	17,0%	21,8%	5,1%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	25,4%	14,8%	15,9%	17,6%	18,5%	17,3%	22,3%	25,4%	22,1%	30,1%	39,9%
27.12.2004	bis	28.12.2009	27,3%	27,5%	27,8%	28,1%	28,8%	30,1%	32,4%	31,4%	33,0%	32,1%	38,1%
28.12.2009	bis	29.12.2014	19,4%	18,0%	18,3%	20,1%	19,7%	21,4%	21,3%	21,9%	22,8%	25,1%	27,9%
29.12.2014	bis	30.12.2019	16,5%	16,2%	15,5%	15,2%	15,5%	15,7%	17,1%	17,0%	17,4%	18,0%	22,3%
30.12.2019	bis	27.12.2021	22,1%	25,2%	24,5%	25,7%	25,0%	26,4%	25,9%	28,1%	28,8%	29,8%	35,7%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	45,7%	26,6%	26,7%	27,5%	37,9%	28,2%	48,5%	50,4%	43,4%	60,0%	79,1%
27.12.2004	bis	28.12.2009	62,0%	62,9%	63,2%	54,6%	68,5%	63,3%	66,1%	68,5%	67,4%	65,8%	70,1%
28.12.2009	bis	29.12.2014	27,7%	22,2%	26,4%	29,3%	28,8%	30,2%	28,2%	32,8%	31,5%	40,5%	55,2%
29.12.2014	bis	30.12.2019	23,5%	13,4%	16,2%	18,9%	17,2%	22,5%	18,0%	17,7%	20,9%	27,0%	31,1%
30.12.2019	bis	27.12.2021	32,1%	37,5%	33,0%	37,7%	37,3%	39,0%	39,1%	41,7%	44,9%	43,4%	51,1%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	18,9%	17,7%	-0,8%	15,4%	11,2%	25,4%	24,3%	15,0%	45,7%
27.12.2004	bis	28.12.2009	15,1%	21,4%	5,1%	27,0%	21,4%	27,3%	61,2%	44,2%	62,0%
28.12.2009	bis	29.12.2014	27,9%	22,5%	14,2%	18,8%	15,7%	19,4%	20,2%	15,6%	27,7%
29.12.2014	bis	30.12.2019	15,0%	11,4%	6,1%	18,2%	15,3%	16,5%	21,8%	17,7%	23,5%
30.12.2019	bis	27.12.2021	17,4%	15,6%	22,9%	27,3%	18,9%	22,1%	38,8%	25,5%	32,1%

Schweiz – SPI

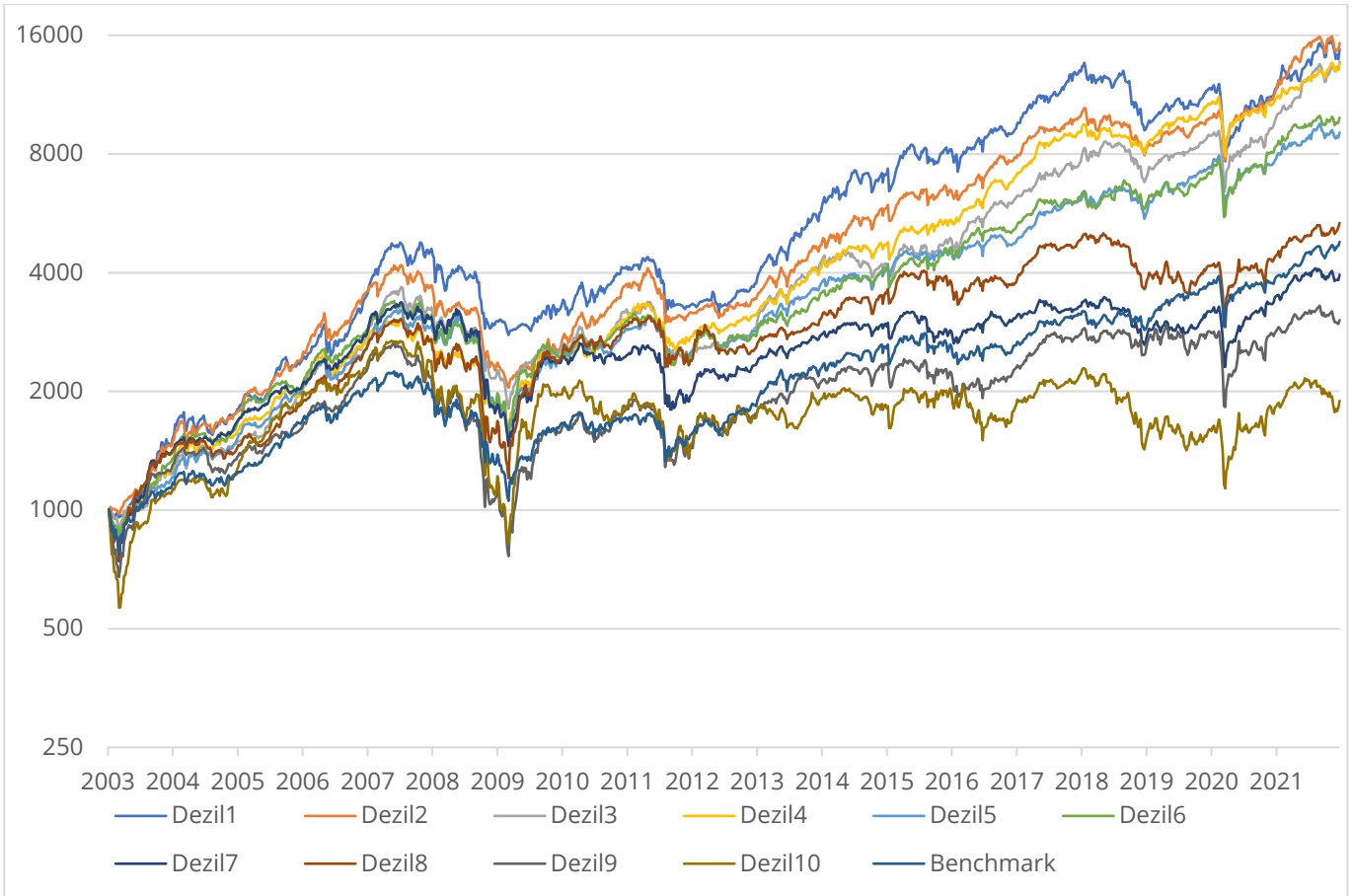
Trend-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	06.01.2003	Region:	Schweiz
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	SPI
Durchschnittliche Anzahl Aktien	135	Scoring-Modell:	Trend-Score

Dezilanalyse

	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	8,6%	15,2%	15,4%	14,7%	14,7%	12,3%	12,8%	7,5%	9,2%	6,0%	3,4%
Annualisierte Volatilität	17,0%	18,5%	16,0%	15,7%	15,1%	15,6%	15,6%	17,0%	19,5%	20,8%	23,8%
Maximaler Drawdown	53,1%	43,7%	51,2%	50,8%	48,9%	53,1%	54,6%	56,9%	60,5%	71,1%	69,4%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,503	0,820	0,966	0,938	0,973	0,788	0,823	0,440	0,472	0,288	0,143
Max 3 Jahre rollierend	129,4%	198,1%	192,8%	164,6%	177,5%	167,9%	176,4%	204,3%	169,5%	172,6%	252,6%
Min 3 Jahre rollierend	-41,1%	-30,0%	-29,6%	-29,4%	-31,6%	-33,5%	-35,5%	-37,0%	-40,3%	-58,0%	-58,7%
Max 5 Jahre rollierend	130,1%	359,7%	271,8%	238,6%	201,3%	226,7%	235,4%	296,4%	222,9%	178,9%	243,6%
Min 5 Jahre rollierend	-29,1%	-31,7%	-24,9%	-28,2%	-5,8%	-19,2%	-23,9%	-35,9%	-22,9%	-45,3%	-41,0%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	68,5%	71,1%	67,7%	71,5%	73,2%	68,9%	43,8%	60,0%	39,6%	40,4%

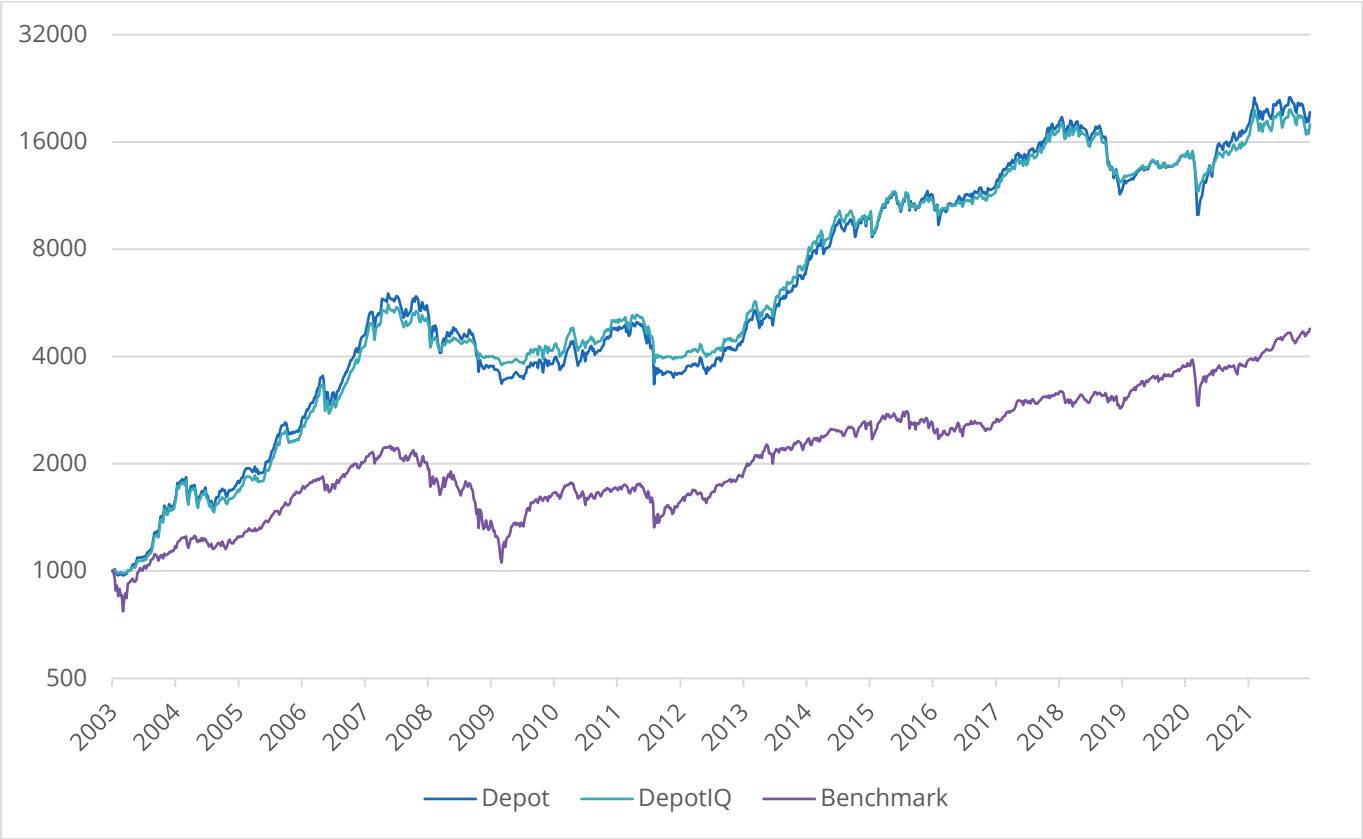


Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	16,8%	16,4%	8,6%
Annualisierte Volatilität	21,6%	18,4%	17,0%
Maximaler Drawdown	46,9%	35,7%	53,1%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,779	0,888	0,503

Anzahl Aktien im Depot	8	
Verkaufskriterium 1	Trend	70%
Verkaufskriterium 2	Trend	70%
Depotumschlagsfaktor	1,72	

Max 3 Jahre rollierend	276,0%	257,4%	129,4%
Min 3 Jahre rollierend	-35,7%	-23,8%	-41,1%
Max 5 Jahre rollierend	456,8%	413,9%	130,1%
Min 5 Jahre rollierend	-38,0%	-25,8%	-29,1%
Anteil Outperformance 1 Jahr	73,6%	74,0%	---



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
06.01.2003	bis	29.12.2003	37,9%	31,3%	4,2%
29.12.2003	bis	27.12.2004	7,5%	13,5%	1,7%
27.12.2004	bis	26.12.2005	9,5%	0,9%	0,7%
26.12.2005	bis	25.12.2006	59,2%	25,6%	9,3%
25.12.2006	bis	31.12.2007	21,7%	18,2%	0,5%
31.12.2007	bis	29.12.2008	2,3%	-1,2%	-16,9%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-23,9%	-15,6%	35,0%
28.12.2009	bis	27.12.2010	20,7%	30,7%	-1,4%
27.12.2010	bis	26.12.2011	-14,5%	-7,1%	-9,6%
26.12.2011	bis	31.12.2012	3,7%	-7,6%	0,7%
31.12.2012	bis	30.12.2013	30,4%	19,7%	-8,3%
30.12.2013	bis	29.12.2014	29,5%	10,4%	-9,4%
29.12.2014	bis	28.12.2015	16,0%	12,9%	1,4%
28.12.2015	bis	26.12.2016	4,7%	17,0%	-4,0%
26.12.2016	bis	25.12.2017	29,9%	13,9%	1,6%
25.12.2017	bis	31.12.2018	-26,4%	-15,4%	-13,2%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-3,7%	-5,6%	-19,2%
30.12.2019	bis	28.12.2020	16,2%	4,3%	3,4%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-13,6%	6,3%	-18,5%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003 bis 27.12.2004	11,1%	33,4%	33,1%	21,7%	25,1%	22,5%	28,0%	29,4%	19,4%	16,1%	11,7%
27.12.2004 bis 28.12.2009	6,0%	12,9%	7,9%	11,5%	9,2%	10,0%	8,5%	7,2%	11,2%	3,3%	9,5%
28.12.2009 bis 29.12.2014	9,5%	16,7%	17,5%	10,5%	14,2%	10,9%	10,9%	4,6%	8,0%	8,2%	-1,2%
29.12.2014 bis 30.12.2019	7,6%	10,7%	11,1%	16,1%	17,7%	12,7%	11,6%	1,4%	3,2%	3,8%	-2,8%
30.12.2019 bis 27.12.2021	13,1%	12,0%	24,6%	24,1%	12,9%	11,0%	17,8%	11,5%	13,4%	3,4%	8,6%

Annualisierte Volatilität	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003 bis 27.12.2004	19,3%	16,3%	14,1%	13,8%	13,8%	13,0%	12,8%	19,6%	19,7%	20,2%	23,7%
27.12.2004 bis 28.12.2009	19,9%	18,9%	17,3%	16,8%	18,1%	18,6%	18,7%	20,0%	24,8%	25,6%	28,3%
28.12.2009 bis 29.12.2014	15,5%	18,0%	15,4%	14,4%	13,5%	14,9%	13,5%	15,3%	16,1%	17,7%	20,3%
29.12.2014 bis 30.12.2019	14,2%	17,0%	13,7%	14,1%	12,0%	11,8%	13,3%	13,1%	15,0%	16,6%	21,0%
30.12.2019 bis 27.12.2021	17,6%	23,9%	20,2%	21,0%	18,7%	19,6%	19,2%	19,0%	22,0%	24,7%	26,4%

Maximaler Drawdown	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003 bis 27.12.2004	23,0%	12,5%	12,1%	11,0%	17,9%	16,0%	14,5%	25,9%	25,3%	32,4%	43,5%
27.12.2004 bis 28.12.2009	53,1%	41,8%	51,2%	50,8%	48,9%	53,1%	54,6%	56,9%	60,5%	71,1%	69,4%
28.12.2009 bis 29.12.2014	25,1%	28,1%	27,5%	29,2%	23,8%	25,0%	26,2%	32,1%	25,7%	32,5%	37,2%
29.12.2014 bis 30.12.2019	16,5%	32,6%	24,1%	21,2%	16,0%	16,5%	15,4%	24,4%	29,8%	20,5%	38,1%
30.12.2019 bis 27.12.2021	25,8%	36,4%	25,5%	30,1%	29,5%	29,3%	28,4%	29,7%	29,0%	35,7%	33,3%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum	Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
06.01.2003 bis 27.12.2004	32,8%	29,2%	11,1%	20,3%	19,7%	19,3%	18,7%	18,6%	22,9%
27.12.2004 bis 28.12.2009	16,7%	20,0%	6,0%	22,2%	18,5%	19,9%	44,2%	32,5%	53,1%
28.12.2009 bis 29.12.2014	20,6%	18,8%	9,5%	20,3%	17,5%	15,5%	33,2%	27,1%	25,1%
29.12.2014 bis 30.12.2019	8,6%	8,3%	7,6%	20,2%	17,3%	14,2%	39,3%	31,9%	16,5%
30.12.2019 bis 27.12.2021	14,8%	10,3%	13,1%	27,5%	21,8%	17,6%	33,9%	23,0%	25,8%

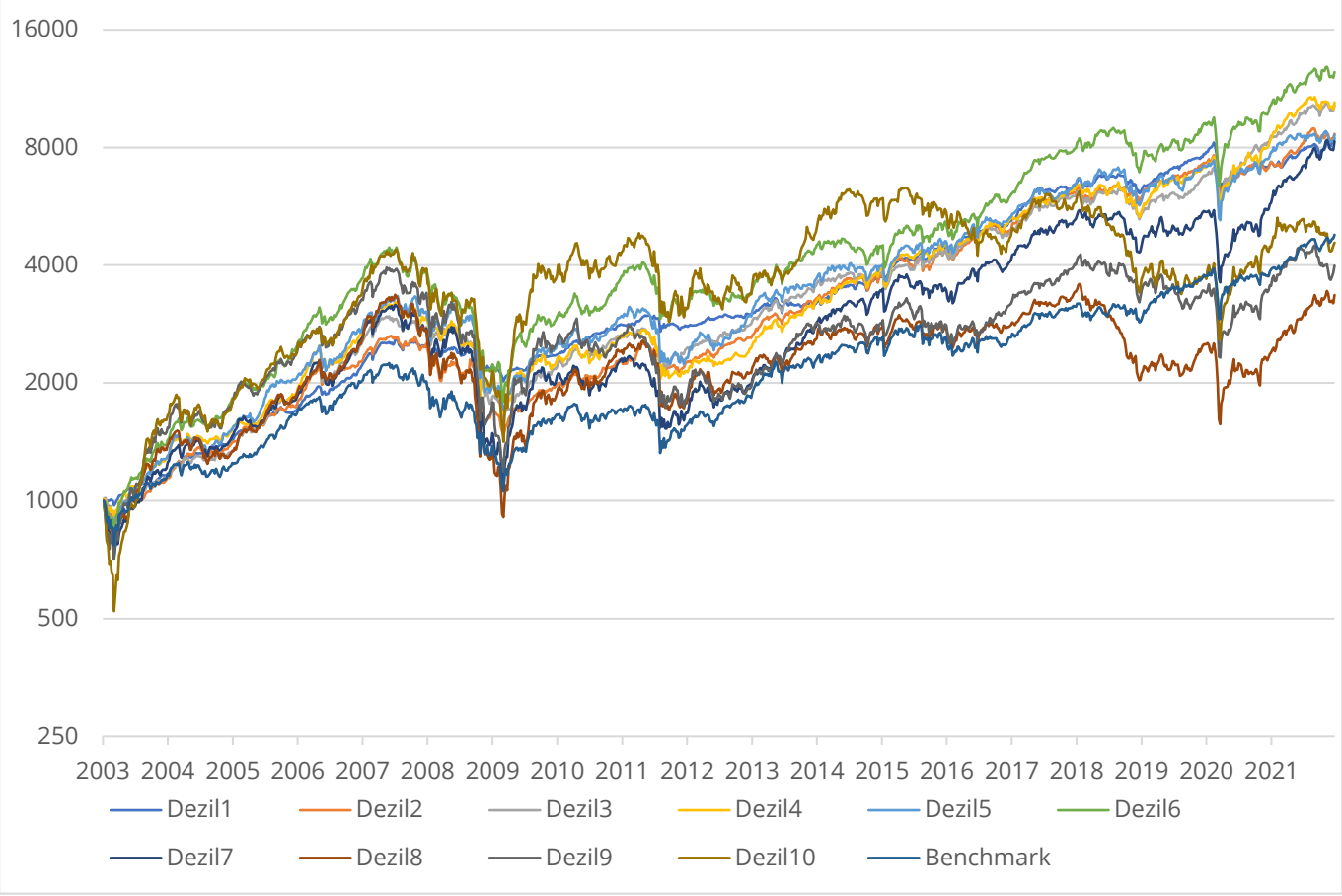
Safety-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	06.01.2003	Region:	Schweiz
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	SPI
Durchschnittliche Anzahl Aktien	135	Scoring-Modell:	Safety-Score

Dezilanalyse

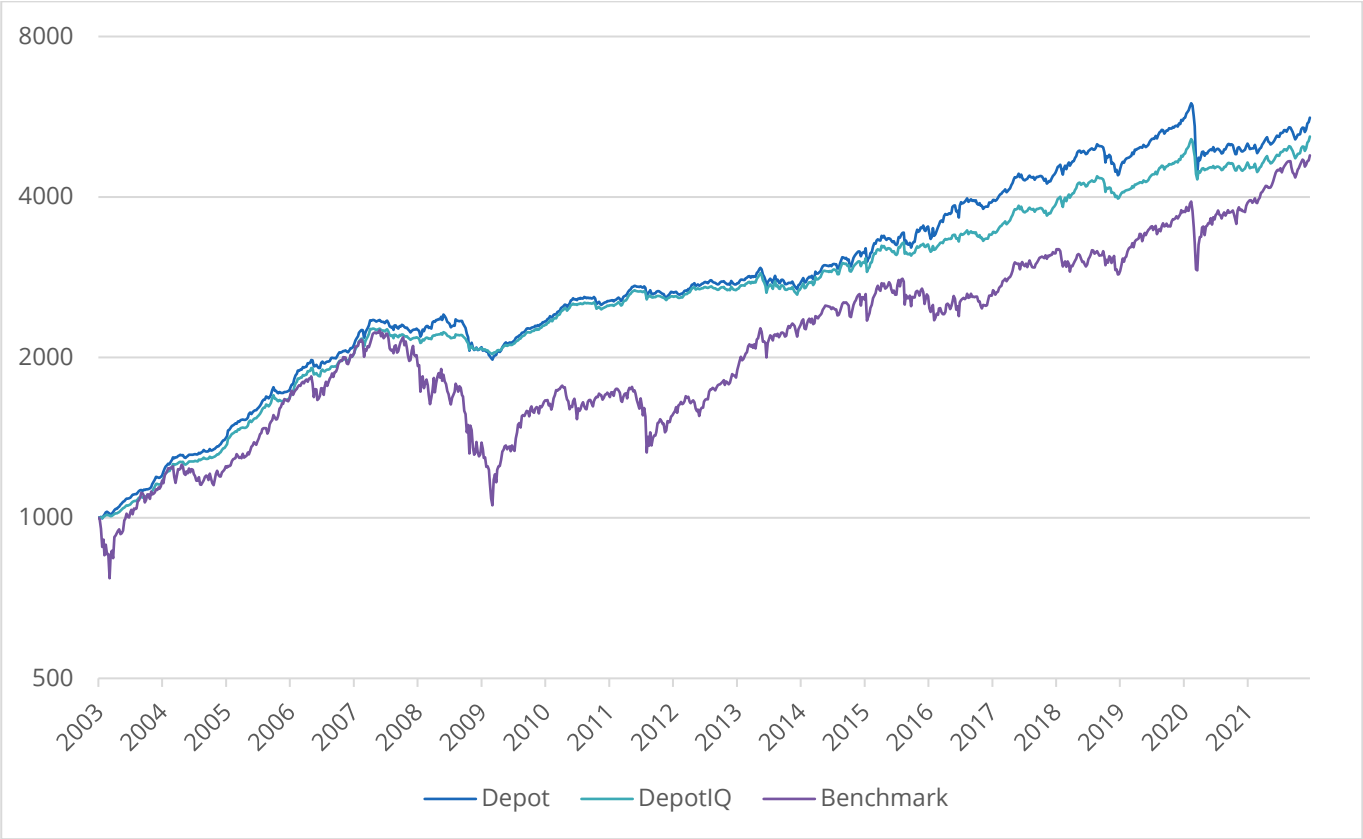
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	8,6%	11,9%	12,0%	13,0%	13,1%	12,0%	14,2%	11,8%	6,6%	7,5%	8,3%
Annualisierte Volatilität	17,0%	8,9%	12,5%	13,5%	15,1%	16,5%	17,5%	19,9%	21,7%	22,8%	26,4%
Maximaler Drawdown	53,1%	26,5%	44,7%	46,1%	48,2%	49,0%	59,7%	65,9%	73,0%	69,9%	67,7%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,503	1,326	0,960	0,966	0,866	0,725	0,810	0,589	0,303	0,331	0,315
Max 3 Jahre rollierend	129,4%	95,9%	128,7%	135,2%	141,8%	166,0%	237,2%	188,3%	169,7%	273,1%	401,5%
Min 3 Jahre rollierend	-41,1%	-0,8%	-28,3%	-22,7%	-30,3%	-25,6%	-36,9%	-47,5%	-55,8%	-54,3%	-51,9%
Max 5 Jahre rollierend	130,1%	148,2%	152,8%	199,1%	198,6%	236,1%	296,3%	251,4%	196,8%	310,2%	522,5%
Min 5 Jahre rollierend	-29,1%	13,5%	-12,0%	-13,5%	-30,5%	-25,7%	-27,9%	-44,1%	-46,3%	-53,5%	-56,1%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	59,6%	67,2%	69,4%	68,5%	64,3%	68,5%	64,3%	46,4%	51,5%	48,9%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	9,5%	9,0%	8,6%
Annualisierte Volatilität	8,4%	6,5%	17,0%
Maximaler Drawdown	26,2%	16,0%	53,1%
Rendite-Risiko-Verhältnis	1,131	1,391	0,503
Max 3 Jahre rollierend	88,5%	85,3%	129,4%
Min 3 Jahre rollierend	2,7%	5,0%	-41,1%
Max 5 Jahre rollierend	126,5%	118,3%	130,1%
Min 5 Jahre rollierend	14,4%	17,0%	-29,1%
Anteil Outperformance 1 Jahr	51,9%	50,2%	---

Anzahl Aktien im Depot	8	
Verkaufskriterium 1	Safety	80%
Verkaufskriterium 2	Safety	80%
Depotumschlagsfaktor	0,57	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
06.01.2003	bis	29.12.2003	4,7%	0,5%	40,8%
29.12.2003	bis	27.12.2004	9,7%	14,9%	4,9%
27.12.2004	bis	26.12.2005	-10,7%	-12,4%	1,2%
26.12.2005	bis	25.12.2006	-0,8%	8,2%	17,8%
25.12.2006	bis	31.12.2007	8,1%	11,9%	10,6%
31.12.2007	bis	29.12.2008	26,6%	12,3%	-14,8%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-13,3%	-13,3%	40,8%
28.12.2009	bis	27.12.2010	5,4%	14,2%	6,3%
27.12.2010	bis	26.12.2011	14,0%	8,5%	-19,1%
26.12.2011	bis	31.12.2012	-15,3%	-6,9%	-10,2%
31.12.2012	bis	30.12.2013	-24,5%	-8,4%	19,9%
30.12.2013	bis	29.12.2014	1,2%	2,2%	-2,7%
29.12.2014	bis	28.12.2015	10,1%	16,4%	-4,4%
28.12.2015	bis	26.12.2016	11,8%	15,0%	-1,3%
26.12.2016	bis	25.12.2017	-7,1%	4,1%	4,9%
25.12.2017	bis	31.12.2018	8,8%	4,3%	-19,9%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-4,7%	-5,5%	-25,5%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-13,3%	-6,2%	8,8%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-11,1%	-6,2%	-17,2%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003	bis	27.12.2004	11,1%	19,4%	18,4%	15,6%	22,9%	23,3%	34,4%	20,5%	15,4%	32,7%	32,1%
27.12.2004	bis	28.12.2009	6,0%	10,6%	7,0%	10,3%	8,3%	10,1%	10,0%	6,7%	6,7%	7,3%	16,2%
28.12.2009	bis	29.12.2014	9,5%	9,6%	13,9%	11,9%	11,7%	10,1%	9,1%	11,4%	8,4%	2,7%	9,8%
29.12.2014	bis	30.12.2019	7,6%	15,5%	14,1%	12,0%	12,7%	12,4%	15,5%	9,7%	-1,9%	3,7%	-8,7%
30.12.2019	bis	27.12.2021	13,1%	4,7%	9,0%	23,2%	21,1%	9,8%	16,3%	23,0%	15,6%	8,0%	10,4%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003	bis	27.12.2004	19,3%	4,6%	8,7%	9,1%	10,8%	13,2%	13,8%	17,5%	19,2%	27,6%	33,1%
27.12.2004	bis	28.12.2009	19,9%	7,8%	15,5%	15,8%	17,0%	19,4%	20,2%	24,9%	26,8%	27,8%	28,7%
28.12.2009	bis	29.12.2014	15,5%	7,9%	10,6%	12,4%	14,0%	15,6%	16,3%	17,7%	18,7%	18,8%	24,9%
29.12.2014	bis	30.12.2019	14,2%	9,4%	10,4%	12,3%	12,8%	14,2%	15,1%	15,7%	16,8%	17,3%	21,1%
30.12.2019	bis	27.12.2021	17,6%	14,5%	16,4%	15,8%	21,0%	19,6%	21,6%	23,2%	27,2%	25,1%	28,1%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003	bis	27.12.2004	23,0%	3,4%	11,5%	11,9%	9,1%	15,7%	15,9%	28,4%	23,6%	29,2%	47,7%
27.12.2004	bis	28.12.2009	53,1%	21,7%	44,7%	46,1%	48,2%	49,0%	59,7%	65,9%	73,0%	69,9%	67,7%
28.12.2009	bis	29.12.2014	25,1%	9,3%	17,2%	24,7%	25,2%	28,7%	28,7%	34,9%	33,5%	40,8%	40,6%
29.12.2014	bis	30.12.2019	16,5%	10,6%	9,2%	16,4%	18,9%	20,0%	22,9%	22,0%	43,3%	27,4%	46,5%
30.12.2019	bis	27.12.2021	25,8%	26,5%	25,6%	21,0%	30,5%	29,9%	33,3%	34,7%	38,0%	35,0%	36,1%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
06.01.2003	bis	27.12.2004	18,5%	16,4%	11,1%	3,5%	3,2%	19,3%	1,3%	1,3%	22,9%
27.12.2004	bis	28.12.2009	10,7%	11,1%	6,0%	7,0%	5,4%	19,9%	17,7%	10,6%	53,1%
28.12.2009	bis	29.12.2014	6,2%	5,6%	9,5%	6,2%	5,6%	15,5%	8,9%	8,9%	25,1%
29.12.2014	bis	30.12.2019	12,0%	9,5%	7,6%	9,3%	7,6%	14,2%	12,5%	9,2%	16,5%
30.12.2019	bis	27.12.2021	0,8%	4,5%	13,1%	15,0%	9,7%	17,6%	26,2%	16,0%	25,8%

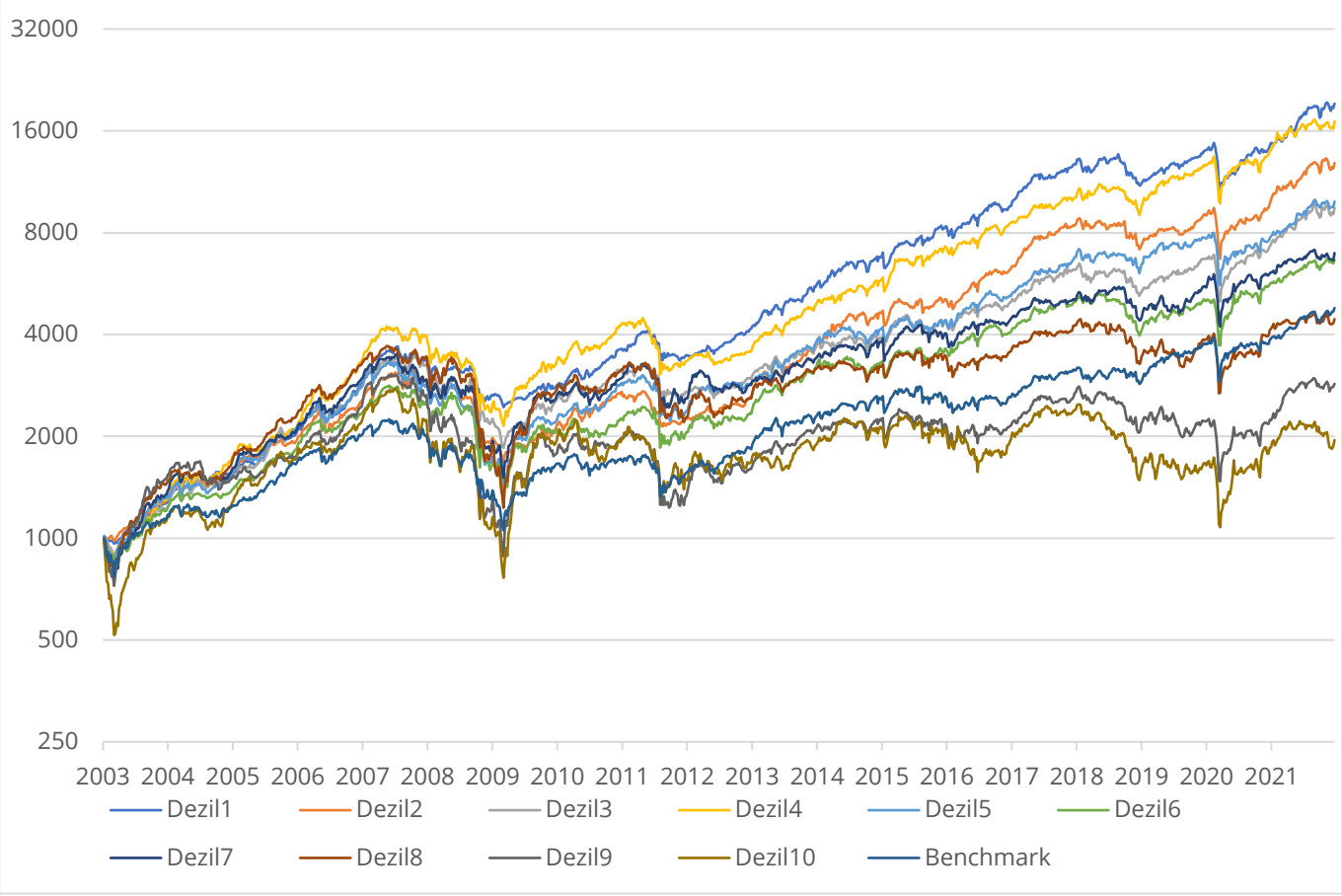
Technischer Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	06.01.2003	Region:	Schweiz
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	SPI
Durchschnittliche Anzahl Aktien	135	Scoring-Modell:	Technischer Score

Dezilanalyse

	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	8,6%	16,8%	14,4%	12,5%	16,1%	12,8%	10,5%	10,7%	8,2%	5,7%	3,6%
Annualisierte Volatilität	17,0%	14,0%	14,4%	15,0%	15,6%	16,0%	16,4%	17,6%	20,1%	21,8%	25,4%
Maximaler Drawdown	53,1%	33,9%	46,5%	47,0%	49,3%	57,6%	52,5%	56,9%	66,7%	71,0%	72,4%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,503	1,203	0,999	0,839	1,029	0,798	0,640	0,609	0,405	0,260	0,141
Max 3 Jahre rollierend	129,4%	152,5%	125,9%	166,6%	191,9%	172,2%	152,6%	205,7%	263,9%	165,1%	260,8%
Min 3 Jahre rollierend	-41,1%	-18,1%	-26,1%	-21,4%	-16,2%	-38,0%	-35,4%	-35,3%	-53,4%	-54,3%	-58,8%
Max 5 Jahre rollierend	130,1%	242,9%	247,0%	227,3%	317,4%	204,8%	191,5%	260,4%	327,1%	211,7%	249,5%
Min 5 Jahre rollierend	-29,1%	-1,5%	-24,6%	-21,5%	-21,2%	-19,6%	-24,0%	-21,1%	-37,0%	-51,5%	-50,2%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	74,0%	66,0%	68,5%	77,5%	65,5%	62,6%	60,9%	57,9%	38,7%	40,0%

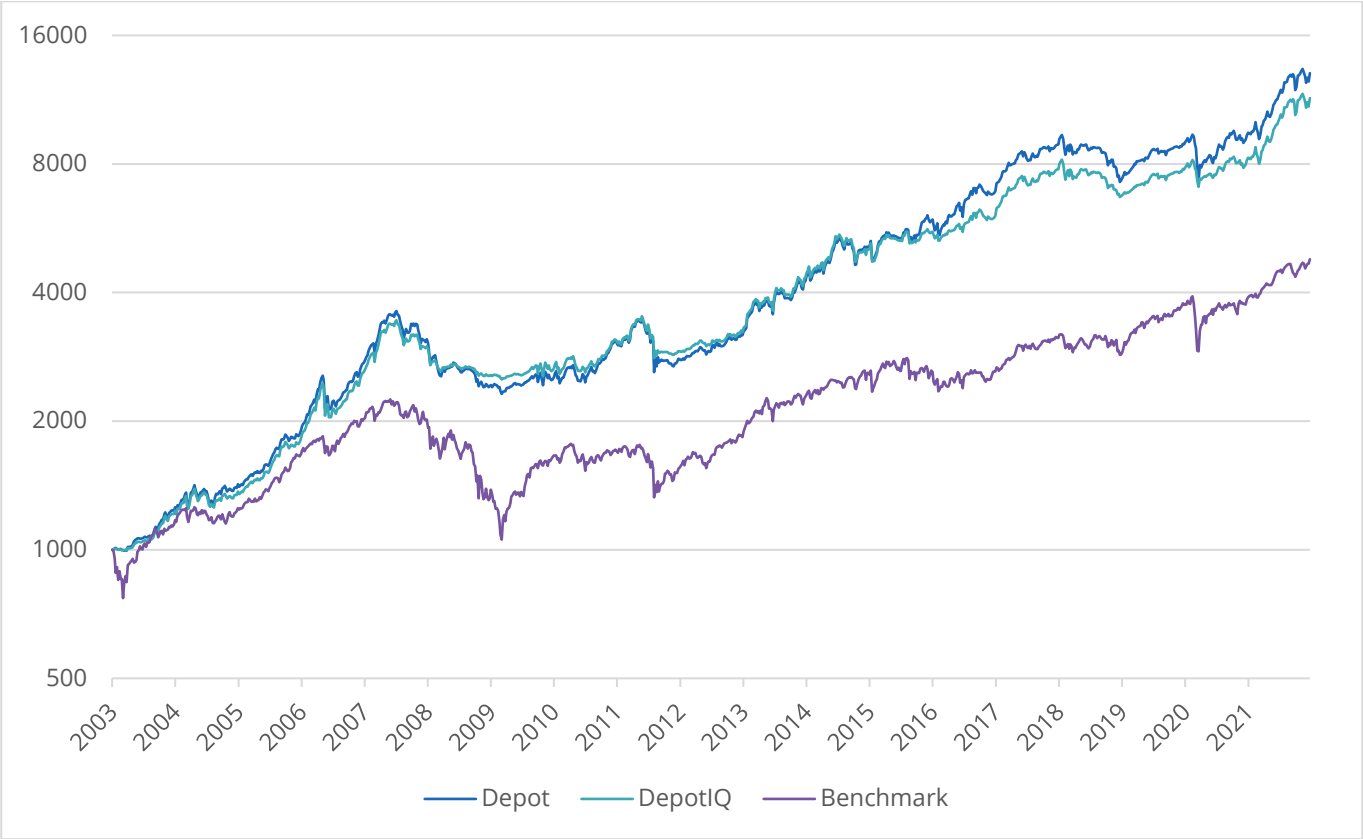


Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	14,4%	13,6%	8,6%
Annualisierte Volatilität	14,6%	12,6%	17,0%
Maximaler Drawdown	36,1%	27,3%	53,1%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,991	1,081	0,503

Anzahl Aktien im Depot	8	
Verkaufskriterium 1	Technisch	70%
Verkaufskriterium 2	Technisch	70%
Depotumschlagsfaktor	1,62	

Max 3 Jahre rollierend	175,2%	166,7%	129,4%
Min 3 Jahre rollierend	-31,9%	-24,6%	-41,1%
Max 5 Jahre rollierend	210,9%	199,6%	130,1%
Min 5 Jahre rollierend	-19,4%	-12,2%	-29,1%
Anteil Outperformance 1 Jahr	68,1%	70,6%	---



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
06.01.2003	bis	29.12.2003	9,1%	13,7%	16,7%
29.12.2003	bis	27.12.2004	5,4%	13,9%	-2,1%
27.12.2004	bis	26.12.2005	-0,6%	-7,4%	-7,6%
26.12.2005	bis	25.12.2006	24,7%	14,6%	12,4%
25.12.2006	bis	31.12.2007	13,5%	17,9%	5,0%
31.12.2007	bis	29.12.2008	12,5%	6,2%	-18,3%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-21,6%	-18,3%	36,8%
28.12.2009	bis	27.12.2010	18,8%	24,2%	1,5%
27.12.2010	bis	26.12.2011	1,0%	-0,2%	-17,5%
26.12.2011	bis	31.12.2012	-5,2%	-0,7%	-1,9%
31.12.2012	bis	30.12.2013	9,6%	12,7%	-2,4%
30.12.2013	bis	29.12.2014	6,2%	10,6%	-3,7%
29.12.2014	bis	28.12.2015	14,2%	15,1%	-3,3%
28.12.2015	bis	26.12.2016	16,5%	19,2%	-4,8%
26.12.2016	bis	25.12.2017	9,8%	14,1%	4,8%
25.12.2017	bis	31.12.2018	-8,8%	-5,2%	-20,6%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-9,0%	-4,6%	-22,9%
30.12.2019	bis	28.12.2020	1,9%	2,7%	3,2%
28.12.2020	bis	27.12.2021	15,5%	8,3%	-7,9%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003	bis	27.12.2004	11,1%	24,9%	25,3%	22,9%	30,7%	23,8%	17,7%	25,8%	29,0%	22,6%	11,9%
27.12.2004	bis	28.12.2009	6,0%	12,4%	6,1%	11,0%	13,8%	7,6%	8,2%	10,3%	10,3%	3,4%	8,8%
28.12.2009	bis	29.12.2014	9,5%	19,2%	17,1%	9,0%	12,1%	13,4%	9,9%	8,0%	3,6%	4,9%	2,2%
29.12.2014	bis	30.12.2019	7,6%	15,6%	14,2%	11,2%	16,8%	13,2%	8,8%	7,8%	3,6%	-0,4%	-4,8%
30.12.2019	bis	27.12.2021	13,1%	17,4%	19,3%	19,1%	16,4%	13,3%	14,9%	12,1%	7,3%	13,6%	8,1%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003	bis	27.12.2004	19,3%	9,6%	10,4%	12,9%	15,0%	14,3%	13,1%	17,2%	22,3%	21,2%	27,2%
27.12.2004	bis	28.12.2009	19,9%	15,0%	15,9%	16,7%	18,0%	18,0%	19,5%	20,8%	24,9%	27,1%	29,7%
28.12.2009	bis	29.12.2014	15,5%	13,3%	12,8%	14,1%	14,2%	15,0%	15,8%	15,9%	16,6%	19,3%	22,0%
29.12.2014	bis	30.12.2019	14,2%	13,0%	13,0%	13,0%	12,8%	13,2%	12,9%	15,0%	15,8%	16,8%	21,2%
30.12.2019	bis	27.12.2021	17,6%	18,5%	19,8%	18,5%	19,5%	20,8%	19,6%	19,8%	22,3%	24,1%	29,3%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003	bis	27.12.2004	23,0%	6,5%	9,2%	12,9%	15,3%	17,0%	16,8%	23,8%	27,8%	27,3%	48,3%
27.12.2004	bis	28.12.2009	53,1%	33,9%	46,5%	47,0%	49,3%	57,6%	52,5%	56,9%	66,7%	71,0%	72,4%
28.12.2009	bis	29.12.2014	25,1%	20,9%	21,5%	22,2%	31,8%	27,0%	24,3%	25,5%	33,5%	40,5%	39,4%
29.12.2014	bis	30.12.2019	16,5%	19,2%	19,0%	19,8%	19,1%	15,2%	24,5%	20,4%	27,9%	29,2%	40,4%
30.12.2019	bis	27.12.2021	25,8%	29,5%	29,3%	27,3%	27,4%	30,0%	27,0%	30,0%	33,3%	34,5%	37,8%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
06.01.2003	bis	27.12.2004	18,3%	16,0%	11,1%	10,6%	10,1%	19,3%	9,8%	9,6%	22,9%
27.12.2004	bis	28.12.2009	12,3%	14,4%	6,0%	14,7%	13,3%	19,9%	36,0%	27,3%	53,1%
28.12.2009	bis	29.12.2014	15,3%	13,8%	9,5%	15,6%	13,5%	15,5%	25,2%	20,1%	25,1%
29.12.2014	bis	30.12.2019	11,7%	9,0%	7,6%	13,1%	11,0%	14,2%	22,4%	18,3%	16,5%
30.12.2019	bis	27.12.2021	21,1%	21,2%	13,1%	18,4%	14,7%	17,6%	22,3%	13,6%	25,8%

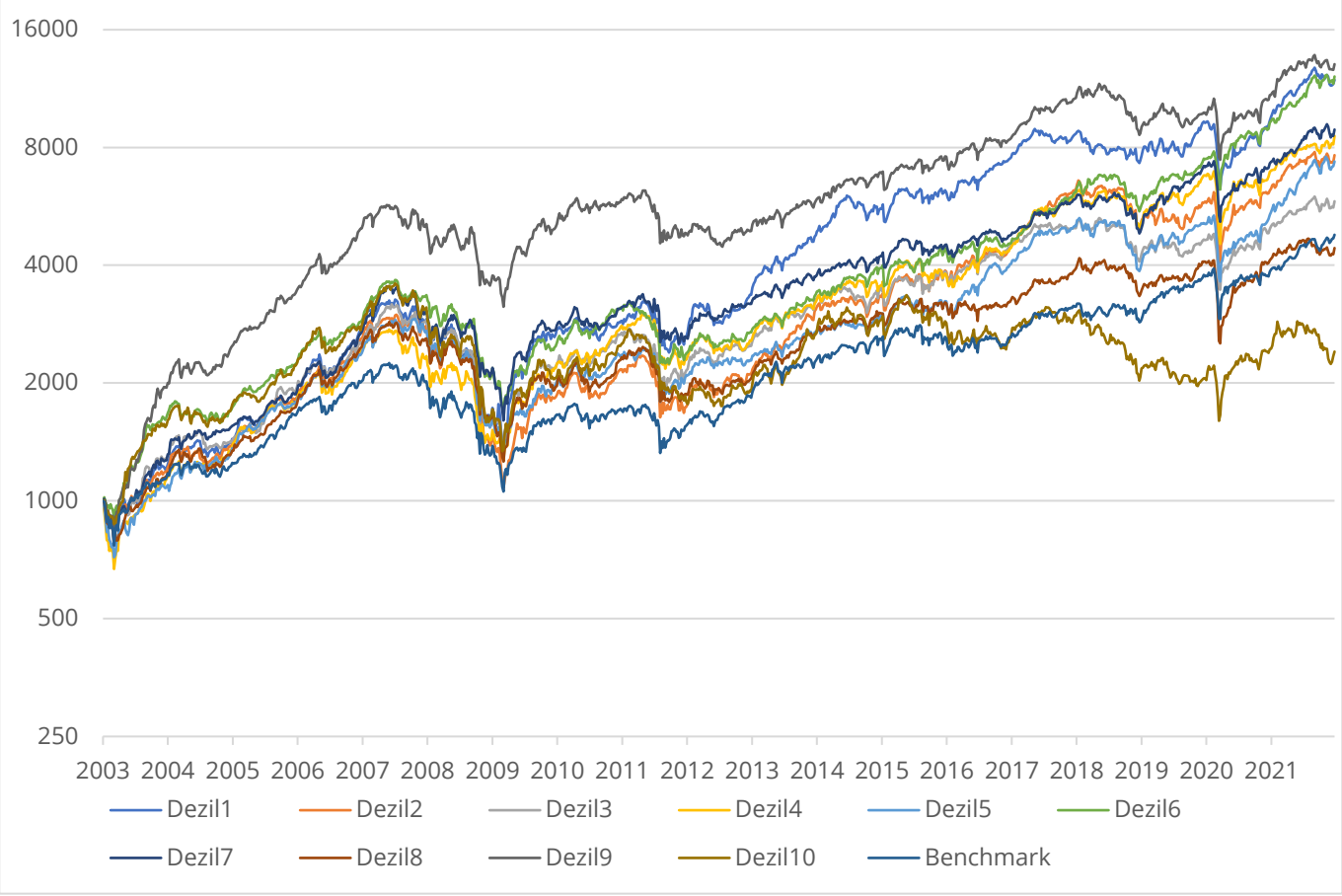
Value-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	06.01.2003	Region:	Schweiz
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	SPI
Durchschnittliche Anzahl Aktien	130	Scoring-Modell:	Value-Score

Dezilanalyse

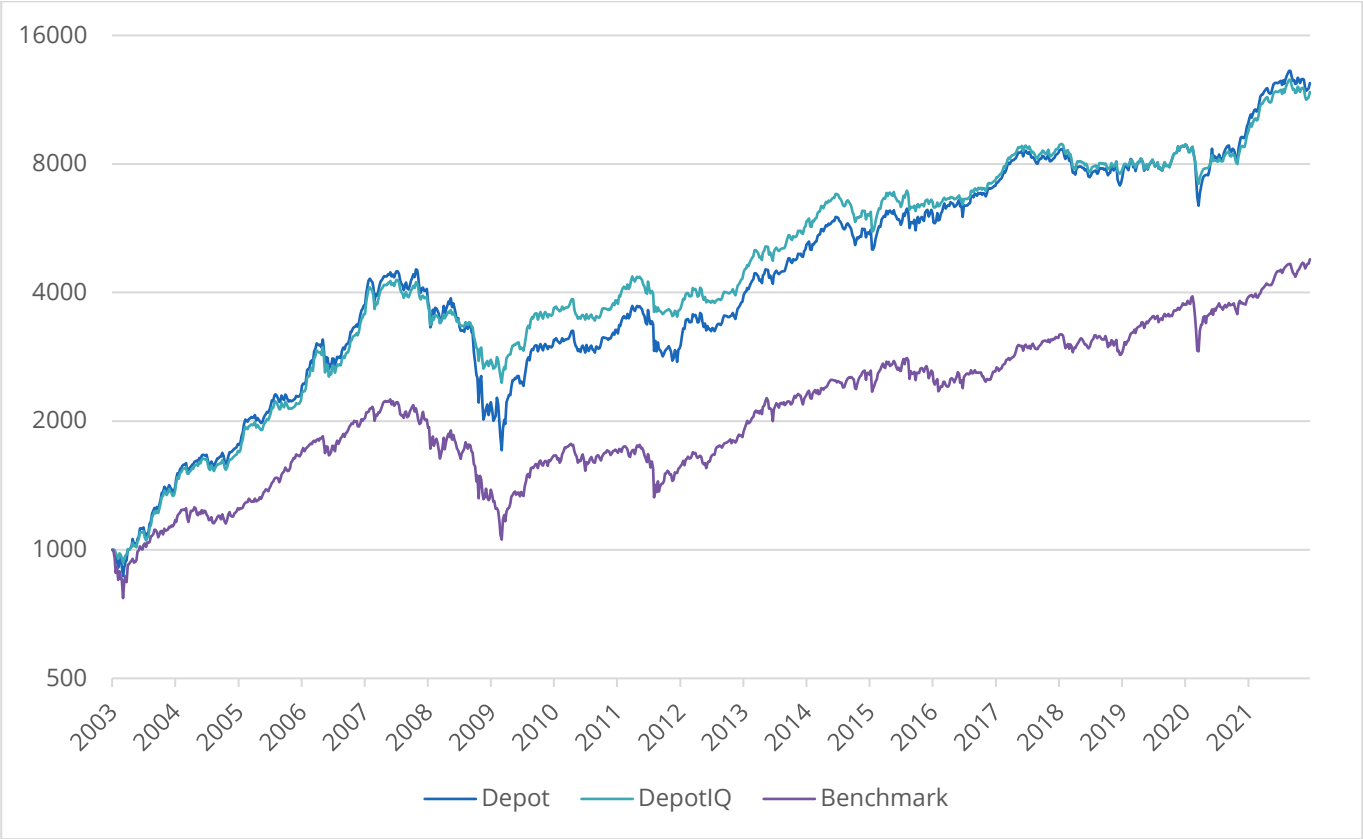
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	8,6%	13,9%	11,3%	9,7%	11,9%	11,1%	14,0%	12,2%	8,1%	14,5%	4,7%
Annualisierte Volatilität	17,0%	18,3%	18,6%	17,4%	17,8%	17,1%	15,6%	16,9%	17,1%	17,2%	19,7%
Maximaler Drawdown	53,1%	58,9%	64,5%	58,8%	53,8%	54,4%	54,3%	54,6%	56,1%	45,0%	62,8%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,503	0,760	0,607	0,557	0,671	0,649	0,897	0,722	0,475	0,838	0,239
Max 3 Jahre rollierend	129,4%	162,3%	135,4%	178,5%	196,0%	177,6%	177,3%	182,0%	159,5%	341,7%	191,2%
Min 3 Jahre rollierend	-41,1%	-36,6%	-46,0%	-38,4%	-36,8%	-32,6%	-33,1%	-26,3%	-36,0%	-19,8%	-47,2%
Max 5 Jahre rollierend	130,1%	274,2%	205,1%	249,9%	214,9%	239,2%	235,4%	257,5%	197,8%	443,3%	212,2%
Min 5 Jahre rollierend	-29,1%	-12,7%	-36,4%	-29,0%	-11,8%	-23,6%	-32,2%	-16,9%	-33,4%	-19,9%	-50,5%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	66,8%	66,4%	55,7%	63,8%	59,2%	67,2%	63,0%	57,5%	73,2%	40,9%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	14,1%	13,8%	8,6%
Annualisierte Volatilität	19,2%	14,5%	17,0%
Maximaler Drawdown	62,2%	42,6%	53,1%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,736	0,955	0,503
Max 3 Jahre rollierend	220,2%	193,1%	129,4%
Min 3 Jahre rollierend	-37,3%	-19,4%	-41,1%
Max 5 Jahre rollierend	318,2%	291,4%	130,1%
Min 5 Jahre rollierend	-27,6%	-11,7%	-29,1%
Anteil Outperformance 1 Jahr	63,0%	64,7%	---

Anzahl Aktien im Depot	8	
Verkaufskriterium 1	Value	90%
Verkaufskriterium 2	Value	90%
Depotumschlagsfaktor	1,07	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
06.01.2003	bis	29.12.2003	22,3%	5,3%	60,8%
29.12.2003	bis	27.12.2004	19,5%	9,0%	11,1%
27.12.2004	bis	26.12.2005	-2,5%	-4,8%	-1,1%
26.12.2005	bis	25.12.2006	38,6%	25,4%	13,1%
25.12.2006	bis	31.12.2007	10,8%	7,1%	8,1%
31.12.2007	bis	29.12.2008	-13,4%	-12,0%	-3,1%
29.12.2008	bis	28.12.2009	16,7%	21,3%	5,9%
28.12.2009	bis	27.12.2010	4,9%	8,7%	14,1%
27.12.2010	bis	26.12.2011	-0,2%	-4,4%	-11,1%
26.12.2011	bis	31.12.2012	10,9%	6,2%	-16,5%
31.12.2012	bis	30.12.2013	8,2%	19,9%	5,3%
30.12.2013	bis	29.12.2014	-4,0%	-1,0%	-0,3%
29.12.2014	bis	28.12.2015	11,6%	12,4%	3,4%
28.12.2015	bis	26.12.2016	14,0%	18,0%	1,1%
26.12.2016	bis	25.12.2017	-1,1%	7,7%	0,6%
25.12.2017	bis	31.12.2018	-5,7%	-8,2%	-15,8%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-9,0%	-10,3%	-24,6%
30.12.2019	bis	28.12.2020	8,4%	1,2%	12,0%
28.12.2020	bis	27.12.2021	2,2%	0,7%	-15,0%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003 bis 27.12.2004	11,1%	19,2%	17,6%	19,0%	16,4%	15,7%	31,0%	24,6%	15,3%	57,9%	31,6%
27.12.2004 bis 28.12.2009	6,0%	13,4%	5,9%	9,2%	10,1%	8,2%	7,8%	12,1%	8,1%	15,1%	3,6%
28.12.2009 bis 29.12.2014	9,5%	16,0%	12,6%	9,7%	10,1%	8,4%	9,6%	9,0%	9,0%	6,7%	7,0%
29.12.2014 bis 30.12.2019	7,6%	10,5%	11,7%	5,7%	13,8%	11,4%	13,6%	11,0%	6,2%	7,2%	-6,6%
30.12.2019 bis 27.12.2021	13,1%	13,5%	14,7%	12,2%	12,4%	20,3%	27,6%	11,6%	4,1%	15,4%	8,2%

Annualisierte Volatilität	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003 bis 27.12.2004	19,3%	15,6%	13,6%	18,9%	19,6%	19,0%	15,4%	19,3%	16,3%	20,2%	17,8%
27.12.2004 bis 28.12.2009	19,9%	23,7%	22,6%	19,4%	20,5%	18,0%	17,3%	19,7%	19,1%	19,1%	23,5%
28.12.2009 bis 29.12.2014	15,5%	16,0%	17,1%	16,7%	15,1%	15,3%	14,3%	15,4%	15,3%	15,3%	16,8%
29.12.2014 bis 30.12.2019	14,2%	14,1%	15,4%	14,5%	14,3%	14,7%	14,3%	12,7%	13,5%	13,4%	17,7%
30.12.2019 bis 27.12.2021	17,6%	19,9%	22,4%	19,1%	22,6%	21,7%	17,8%	19,3%	24,1%	21,4%	22,6%

Maximaler Drawdown	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003 bis 27.12.2004	23,0%	18,3%	14,6%	24,0%	33,0%	28,2%	11,6%	23,9%	20,8%	13,9%	13,0%
27.12.2004 bis 28.12.2009	53,1%	58,9%	64,5%	58,8%	53,8%	54,4%	54,3%	54,6%	56,1%	45,0%	62,8%
28.12.2009 bis 29.12.2014	25,1%	25,9%	30,4%	30,9%	27,5%	27,1%	29,8%	25,1%	27,8%	28,3%	36,3%
29.12.2014 bis 30.12.2019	16,5%	18,2%	25,0%	22,6%	20,2%	26,7%	19,5%	21,3%	20,1%	26,1%	41,5%
30.12.2019 bis 27.12.2021	25,8%	32,9%	33,8%	28,1%	34,8%	32,3%	20,1%	30,0%	38,7%	30,3%	27,9%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum	Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
06.01.2003 bis 27.12.2004	32,2%	29,6%	11,1%	15,7%	12,8%	19,3%	13,3%	6,8%	22,9%
27.12.2004 bis 28.12.2009	11,5%	16,3%	6,0%	25,4%	17,7%	19,9%	62,2%	42,6%	53,1%
28.12.2009 bis 29.12.2014	13,0%	11,3%	9,5%	16,4%	13,5%	15,5%	26,1%	19,6%	25,1%
29.12.2014 bis 30.12.2019	9,6%	7,5%	7,6%	15,5%	12,5%	14,2%	17,8%	14,8%	16,5%
30.12.2019 bis 27.12.2021	18,7%	15,9%	13,1%	19,3%	14,2%	17,6%	28,1%	19,0%	25,8%

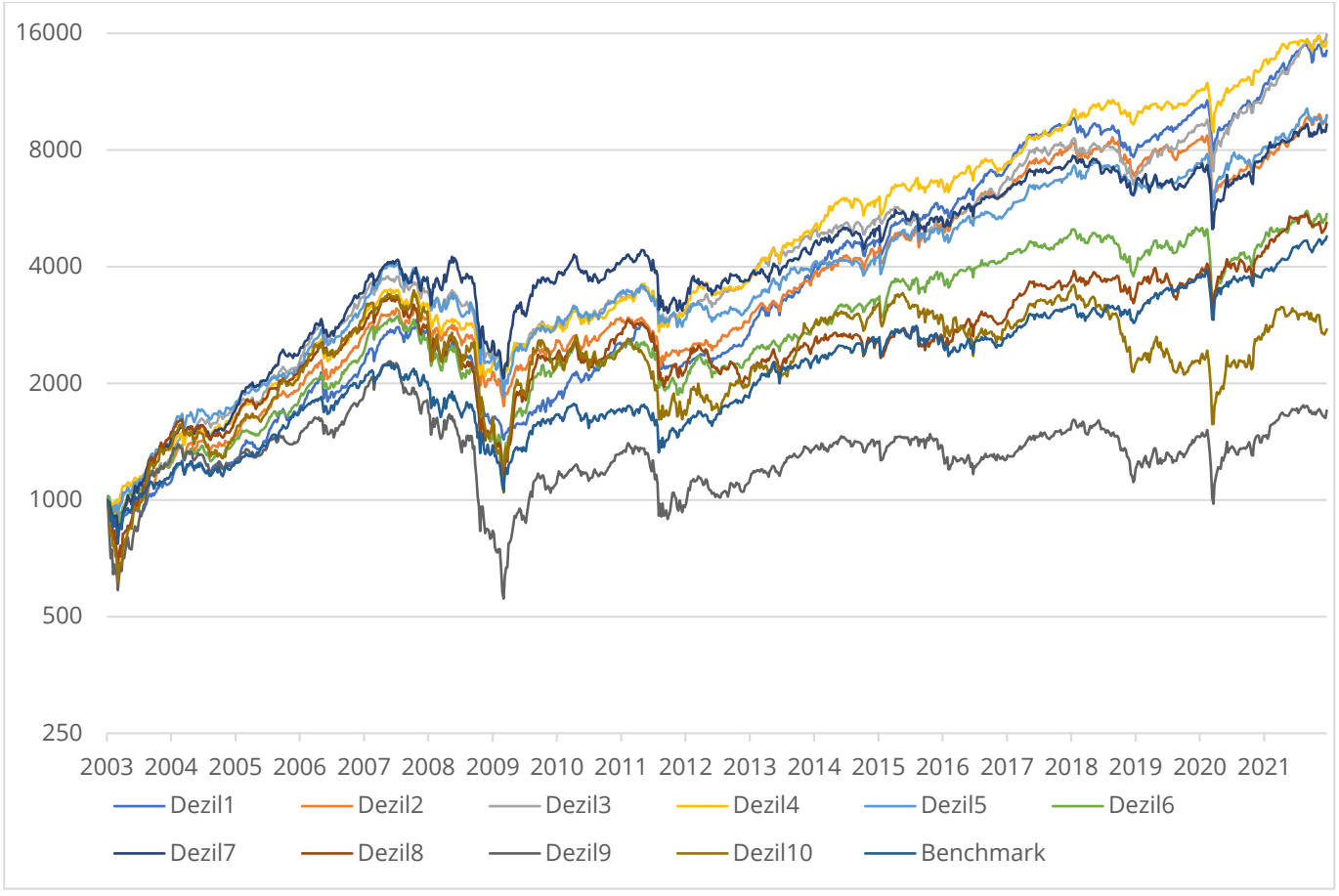
Kombi-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	06.01.2003	Region:	Schweiz
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	SPI
Durchschnittliche Anzahl Aktien	130	Scoring-Modell:	Kombi-Score

Dezilanalyse

	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	8,6%	15,1%	12,7%	15,6%	15,4%	12,8%	9,3%	12,4%	9,0%	2,8%	5,5%
Annualisierte Volatilität	17,0%	15,3%	15,5%	14,6%	14,8%	15,8%	17,6%	18,3%	19,5%	21,7%	23,9%
Maximaler Drawdown	53,1%	51,0%	44,2%	47,4%	41,1%	54,7%	58,6%	51,5%	66,8%	75,6%	70,0%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,503	0,986	0,820	1,072	1,036	0,810	0,532	0,679	0,463	0,130	0,228
Max 3 Jahre rollierend	129,4%	142,4%	141,9%	178,8%	145,9%	175,6%	149,5%	217,5%	238,2%	171,2%	285,4%
Min 3 Jahre rollierend	-41,1%	-27,7%	-20,1%	-23,9%	-18,1%	-28,5%	-38,4%	-24,8%	-51,5%	-64,8%	-56,1%
Max 5 Jahre rollierend	130,1%	287,9%	208,9%	248,9%	221,6%	269,8%	187,6%	336,8%	261,1%	165,7%	309,5%
Min 5 Jahre rollierend	-29,1%	-16,7%	-20,2%	-14,6%	-1,8%	-28,3%	-28,1%	-16,9%	-35,6%	-57,2%	-52,0%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	71,9%	69,8%	74,0%	80,4%	66,0%	56,2%	66,4%	58,3%	30,2%	47,2%

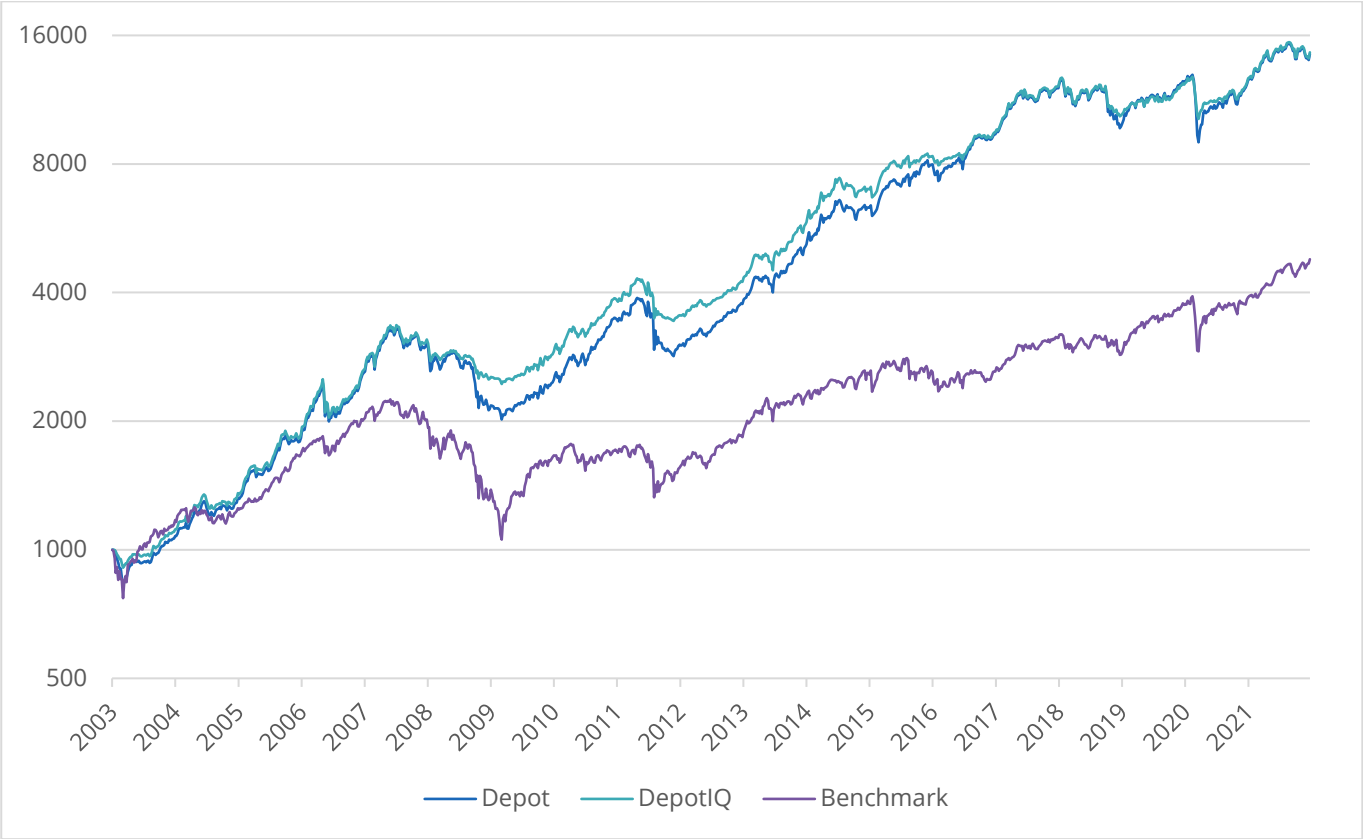


Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	15,1%	15,1%	8,6%
Annualisierte Volatilität	15,4%	12,7%	17,0%
Maximaler Drawdown	39,0%	27,3%	53,1%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,977	1,192	0,503

Anzahl Aktien im Depot	8	
Verkaufskriterium 1	Kombi	70%
Verkaufskriterium 2	Kombi	70%
Depotumschlagsfaktor	1,17	

Max 3 Jahre rollierend	171,6%	166,0%	129,4%
Min 3 Jahre rollierend	-18,2%	-6,5%	-41,1%
Max 5 Jahre rollierend	271,8%	219,3%	130,1%
Min 5 Jahre rollierend	-2,9%	12,0%	-29,1%
Anteil Outperformance 1 Jahr	70,6%	70,6%	---



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
06.01.2003	bis	29.12.2003	-8,4%	1,5%	16,0%
29.12.2003	bis	27.12.2004	13,7%	8,4%	-5,1%
27.12.2004	bis	26.12.2005	4,8%	-1,1%	-6,4%
26.12.2005	bis	25.12.2006	22,4%	14,2%	13,9%
25.12.2006	bis	31.12.2007	18,0%	17,1%	2,0%
31.12.2007	bis	29.12.2008	4,6%	-1,1%	-18,3%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-9,7%	-8,5%	15,5%
28.12.2009	bis	27.12.2010	37,4%	24,4%	10,9%
27.12.2010	bis	26.12.2011	-4,2%	-4,1%	-18,4%
26.12.2011	bis	31.12.2012	7,0%	-0,4%	-2,8%
31.12.2012	bis	30.12.2013	11,7%	13,5%	6,5%
30.12.2013	bis	29.12.2014	9,8%	4,7%	-3,9%
29.12.2014	bis	28.12.2015	24,7%	19,2%	-4,9%
28.12.2015	bis	26.12.2016	18,4%	22,6%	-8,1%
26.12.2016	bis	25.12.2017	8,2%	11,1%	2,6%
25.12.2017	bis	31.12.2018	-9,9%	-7,3%	-22,7%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-4,1%	-2,6%	-13,5%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-3,9%	-3,3%	5,7%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-6,5%	4,5%	-14,5%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003	bis	27.12.2004	11,1%	11,5%	20,9%	31,2%	27,9%	32,4%	18,7%	30,0%	26,0%	10,9%	20,7%
27.12.2004	bis	28.12.2009	6,0%	7,9%	11,2%	10,4%	11,1%	9,8%	9,1%	16,6%	7,9%	-2,3%	8,7%
28.12.2009	bis	29.12.2014	9,5%	20,6%	11,8%	13,4%	16,6%	8,7%	8,8%	6,7%	2,0%	5,3%	7,6%
29.12.2014	bis	30.12.2019	7,6%	17,0%	14,2%	11,6%	13,6%	11,8%	8,4%	7,4%	8,3%	0,6%	-6,4%
30.12.2019	bis	27.12.2021	13,1%	18,6%	7,4%	31,3%	16,1%	15,4%	5,0%	13,8%	16,7%	8,0%	9,9%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003	bis	27.12.2004	19,3%	12,3%	13,0%	11,5%	13,4%	15,9%	17,3%	16,1%	24,1%	28,5%	24,9%
27.12.2004	bis	28.12.2009	19,9%	17,9%	17,1%	16,5%	16,0%	18,6%	19,4%	21,7%	22,9%	26,3%	29,0%
28.12.2009	bis	29.12.2014	15,5%	14,2%	14,1%	13,7%	14,9%	13,2%	15,1%	17,3%	17,0%	17,8%	20,8%
29.12.2014	bis	30.12.2019	14,2%	12,9%	14,7%	12,4%	12,7%	13,3%	14,8%	13,8%	15,4%	15,7%	19,2%
30.12.2019	bis	27.12.2021	17,6%	18,8%	19,0%	18,9%	17,9%	19,1%	24,2%	23,3%	20,6%	22,9%	27,1%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003	bis	27.12.2004	23,0%	18,8%	11,9%	6,6%	7,1%	12,1%	21,5%	15,1%	32,5%	41,5%	38,7%
27.12.2004	bis	28.12.2009	53,1%	51,0%	44,2%	47,4%	41,1%	54,7%	58,6%	51,5%	66,8%	75,6%	70,0%
28.12.2009	bis	29.12.2014	25,1%	24,3%	25,9%	21,1%	24,9%	22,0%	26,8%	31,3%	32,9%	36,3%	39,4%
29.12.2014	bis	30.12.2019	16,5%	20,9%	20,6%	24,1%	13,6%	18,0%	24,5%	21,1%	17,6%	31,1%	41,4%
30.12.2019	bis	27.12.2021	25,8%	28,9%	34,0%	26,4%	25,4%	27,4%	40,1%	32,4%	24,1%	35,5%	35,3%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
06.01.2003	bis	27.12.2004	13,6%	15,0%	11,1%	10,9%	8,7%	19,3%	17,7%	9,2%	22,9%
27.12.2004	bis	28.12.2009	13,8%	16,7%	6,0%	16,9%	14,4%	19,9%	39,0%	27,3%	53,1%
28.12.2009	bis	29.12.2014	20,7%	19,4%	9,5%	15,7%	13,1%	15,5%	27,0%	20,5%	25,1%
29.12.2014	bis	30.12.2019	14,4%	11,9%	7,6%	13,6%	11,5%	14,2%	23,1%	18,8%	16,5%
30.12.2019	bis	27.12.2021	8,0%	9,1%	13,1%	18,5%	13,5%	17,6%	30,6%	20,3%	25,8%

Italien + Spanien – Comit Globale & Madrid SE General

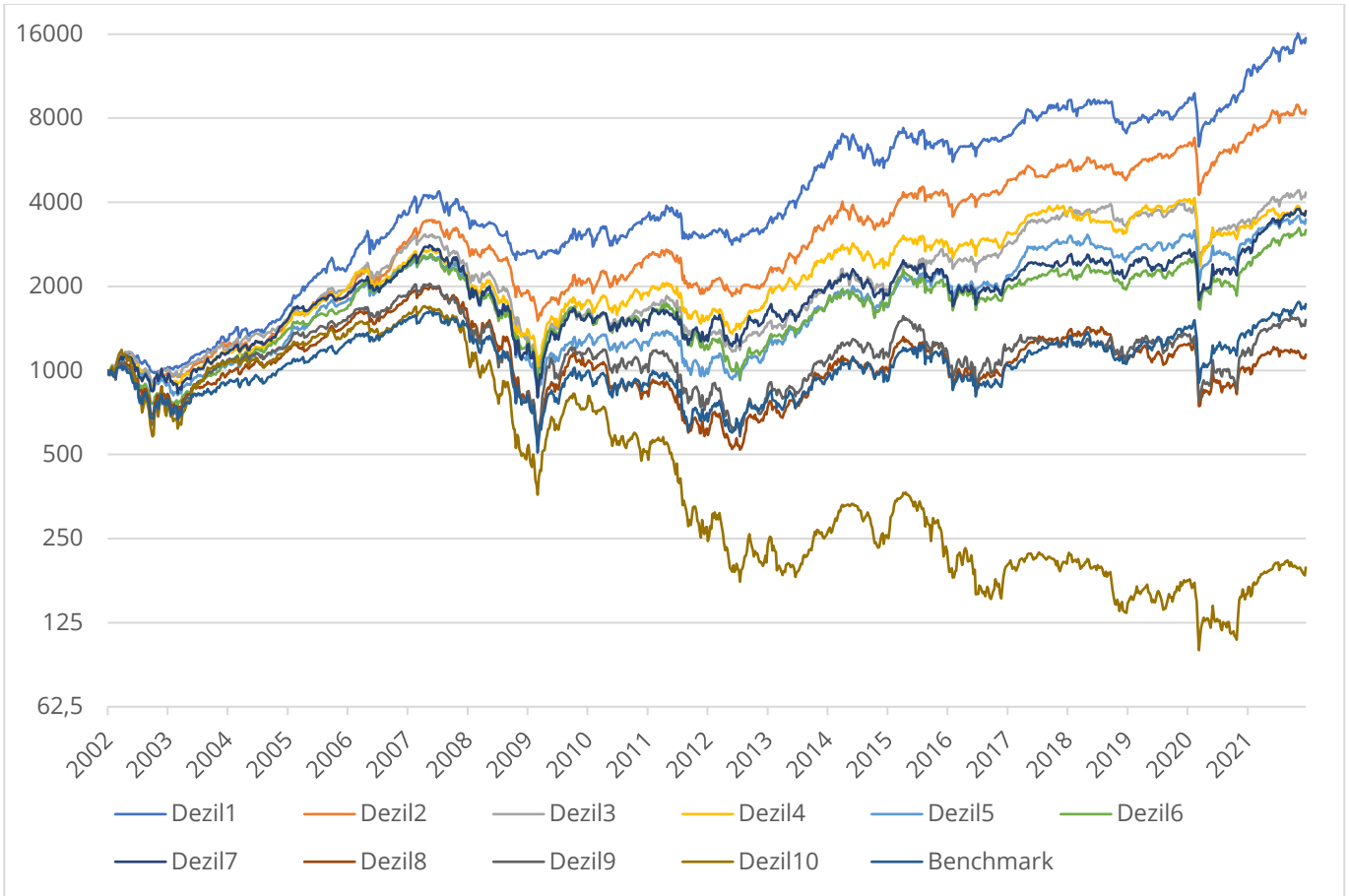
Trend-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Italien + Spanien
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	FTSE MIB
Durchschnittliche Anzahl Aktien	208	Scoring-Modell:	Trend-Score

Dezilanalyse

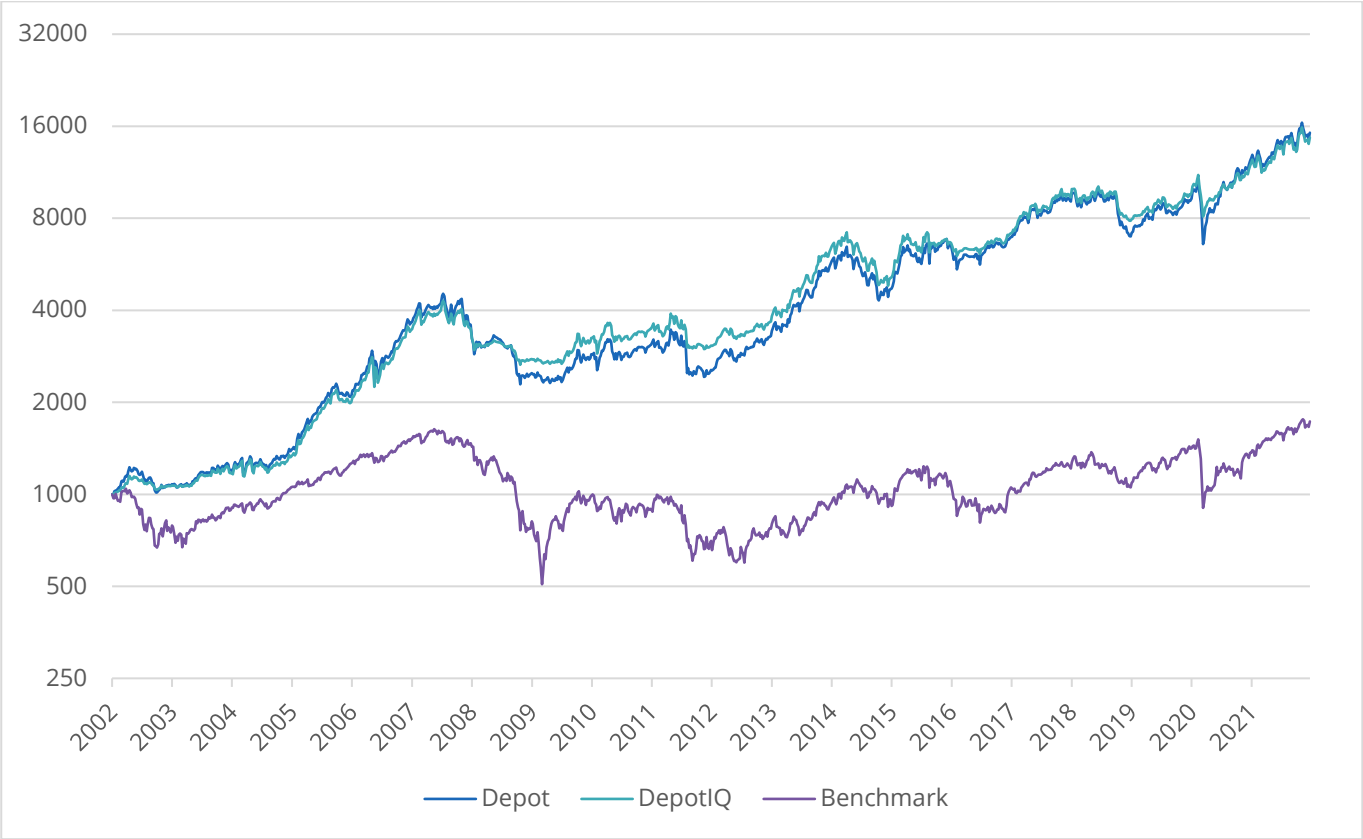
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	2,8%	14,7%	11,3%	7,6%	6,8%	6,4%	6,0%	6,8%	0,7%	2,1%	-7,8%
Annualisierte Volatilität	23,7%	19,8%	17,7%	18,1%	18,5%	18,9%	19,7%	21,1%	22,4%	24,7%	30,7%
Maximaler Drawdown	68,9%	43,2%	56,4%	67,5%	61,8%	68,5%	64,7%	71,5%	73,9%	71,9%	94,1%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,117	0,742	0,640	0,419	0,367	0,339	0,303	0,321	0,029	0,085	-0,254
Max 3 Jahre rollierend	106,9%	216,4%	189,6%	138,7%	150,0%	140,4%	158,7%	146,8%	140,9%	154,8%	142,4%
Min 3 Jahre rollierend	-62,1%	-34,4%	-42,5%	-55,1%	-53,7%	-59,1%	-52,3%	-60,9%	-64,1%	-65,3%	-75,8%
Max 5 Jahre rollierend	128,5%	316,1%	247,0%	201,2%	184,2%	200,2%	205,6%	195,3%	163,8%	179,8%	167,3%
Min 5 Jahre rollierend	-62,7%	-32,9%	-45,6%	-61,3%	-49,4%	-63,1%	-60,9%	-55,6%	-73,3%	-69,3%	-89,2%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	77,0%	79,8%	65,3%	63,7%	64,1%	65,3%	68,2%	51,2%	53,2%	23,4%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	14,6%	14,3%	2,8%
Annualisierte Volatilität	22,3%	19,3%	23,7%
Maximaler Drawdown	49,6%	38,2%	68,9%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,652	0,742	0,117
Max 3 Jahre rollierend	261,5%	249,8%	106,9%
Min 3 Jahre rollierend	-38,4%	-25,5%	-62,1%
Max 5 Jahre rollierend	316,2%	296,8%	128,5%
Min 5 Jahre rollierend	-36,9%	-22,9%	-62,7%
Anteil Outperformance 1 Jahr	71,0%	71,4%	---

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Trend	70%
Verkaufskriterium 2	Trend	70%
Depotumschlagsfaktor	1,66	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	32,0%	23,7%	-3,7%
30.12.2002	bis	29.12.2003	-6,5%	7,3%	30,4%
29.12.2003	bis	27.12.2004	-2,5%	6,4%	-4,9%
27.12.2004	bis	26.12.2005	30,9%	12,4%	-1,3%
26.12.2005	bis	25.12.2006	53,4%	37,9%	0,1%
25.12.2006	bis	31.12.2007	1,6%	4,1%	-16,0%
31.12.2007	bis	29.12.2008	16,4%	15,8%	-8,1%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-14,2%	-13,6%	24,4%
28.12.2009	bis	27.12.2010	18,7%	26,7%	-11,4%
27.12.2010	bis	26.12.2011	4,9%	4,7%	-13,6%
26.12.2011	bis	31.12.2012	19,1%	-4,8%	-23,3%
31.12.2012	bis	30.12.2013	51,4%	47,1%	10,2%
30.12.2013	bis	29.12.2014	-20,8%	-3,5%	0,4%
29.12.2014	bis	28.12.2015	25,2%	7,3%	-17,5%
28.12.2015	bis	26.12.2016	10,8%	10,4%	-3,0%
26.12.2016	bis	25.12.2017	14,7%	3,7%	-13,8%
25.12.2017	bis	31.12.2018	-9,4%	0,1%	-7,6%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-2,9%	-3,3%	-8,8%
30.12.2019	bis	28.12.2020	38,3%	20,0%	-8,4%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-2,8%	3,5%	0,9%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	1,6%	18,2%	13,3%	15,0%	13,6%	8,5%	11,2%	14,3%	5,3%	6,8%	5,9%
27.12.2004	bis	28.12.2009	-1,4%	13,5%	7,3%	1,2%	3,7%	0,3%	2,6%	0,8%	-2,0%	-0,9%	-9,0%
28.12.2009	bis	29.12.2014	-0,4%	12,7%	10,4%	4,0%	6,7%	6,0%	2,3%	4,0%	-0,5%	0,0%	-18,9%
29.12.2014	bis	30.12.2019	7,9%	9,9%	13,4%	13,8%	10,8%	11,8%	6,8%	6,8%	3,7%	3,0%	-7,3%
30.12.2019	bis	27.12.2021	10,7%	30,7%	15,9%	7,6%	-4,5%	7,0%	14,6%	19,0%	-3,9%	6,4%	6,0%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	22,4%	11,2%	10,9%	11,9%	11,6%	13,0%	14,0%	17,0%	20,4%	21,1%	28,5%
27.12.2004	bis	28.12.2009	24,1%	20,0%	18,6%	19,5%	20,4%	21,5%	20,9%	24,2%	23,6%	25,3%	28,2%
28.12.2009	bis	29.12.2014	25,0%	21,7%	19,4%	19,1%	19,0%	20,1%	20,9%	21,4%	22,8%	25,3%	32,8%
29.12.2014	bis	30.12.2019	20,7%	18,8%	15,2%	15,3%	15,7%	15,7%	16,7%	17,4%	18,5%	22,4%	29,6%
30.12.2019	bis	27.12.2021	28,1%	25,7%	23,9%	25,1%	25,9%	23,5%	26,5%	25,7%	29,7%	31,7%	37,2%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	35,9%	15,9%	18,4%	22,5%	23,1%	26,7%	29,7%	27,5%	36,3%	40,0%	51,1%
27.12.2004	bis	28.12.2009	68,9%	43,2%	56,4%	67,5%	61,8%	68,5%	64,7%	71,5%	71,2%	71,9%	78,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	40,2%	27,5%	31,8%	36,9%	34,1%	33,7%	46,0%	26,8%	52,0%	51,7%	78,4%
29.12.2014	bis	30.12.2019	34,7%	24,4%	21,9%	17,0%	20,9%	20,5%	28,7%	31,4%	36,5%	44,9%	62,9%
30.12.2019	bis	27.12.2021	40,4%	35,4%	37,7%	38,9%	43,1%	35,1%	34,8%	34,0%	40,8%	42,4%	44,2%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	11,5%	9,8%	1,6%	15,0%	13,2%	22,4%	17,3%	11,1%	35,8%
27.12.2004	bis	28.12.2009	15,0%	19,0%	-1,4%	23,2%	20,4%	24,1%	49,5%	38,2%	68,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	10,9%	10,0%	-0,4%	23,3%	21,2%	25,0%	33,2%	33,2%	40,2%
29.12.2014	bis	30.12.2019	14,2%	13,2%	7,9%	20,9%	17,7%	20,7%	29,2%	22,7%	34,7%
30.12.2019	bis	27.12.2021	29,3%	24,3%	10,7%	29,6%	23,4%	28,1%	38,0%	26,9%	40,4%

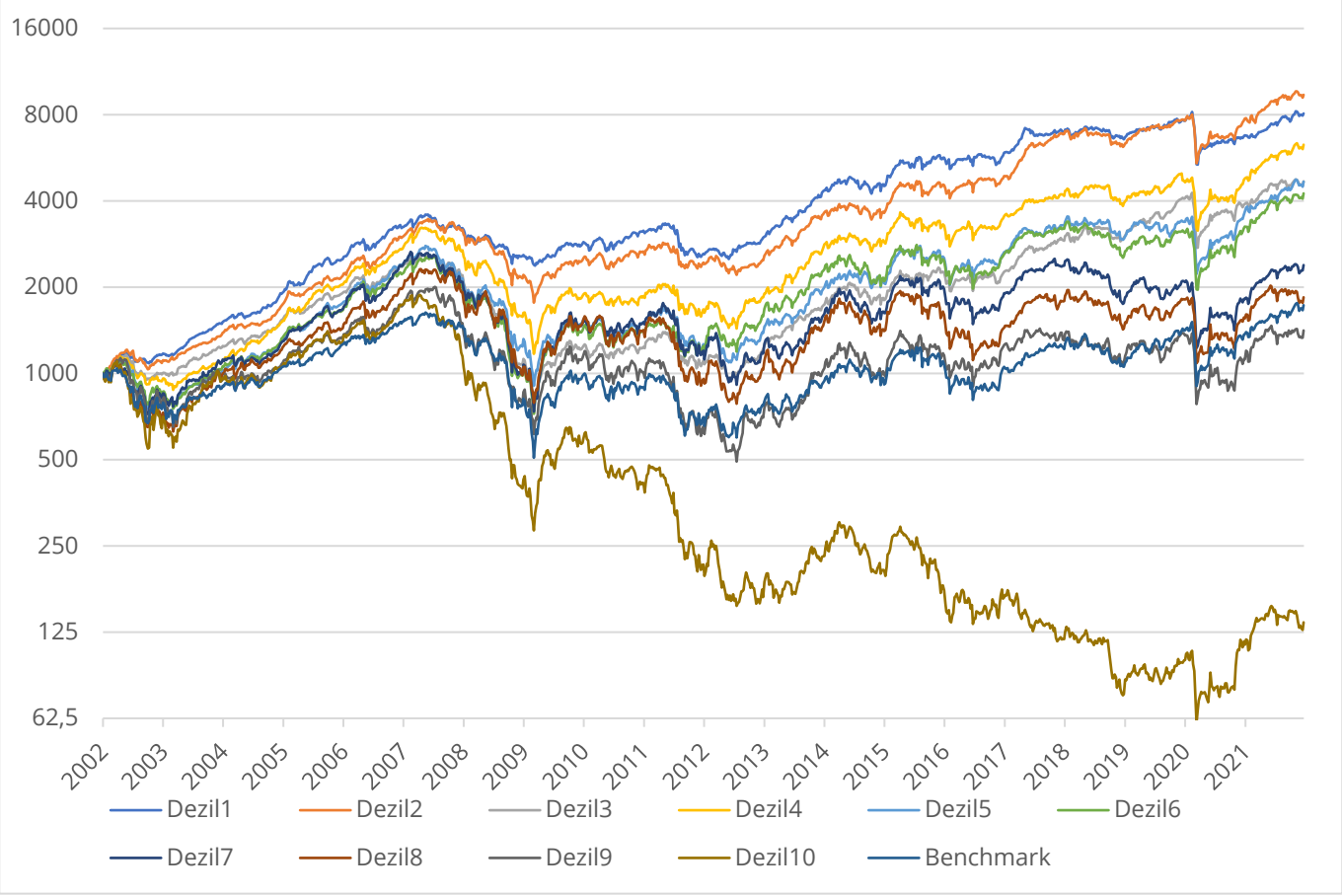
Safety-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Italien + Spanien
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	FTSE MIB
Durchschnittliche Anzahl Aktien	208	Scoring-Modell:	Safety-Score

Dezilanalyse

	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	2,8%	11,0%	11,8%	8,0%	9,6%	8,0%	7,5%	4,5%	3,1%	1,7%	-9,5%
Annualisierte Volatilität	23,7%	12,9%	14,4%	16,6%	17,3%	19,2%	21,2%	23,4%	25,1%	26,8%	31,8%
Maximaler Drawdown	68,9%	34,6%	49,0%	69,2%	63,7%	67,6%	71,8%	72,3%	66,1%	75,5%	96,8%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,117	0,851	0,824	0,484	0,555	0,416	0,354	0,190	0,124	0,065	-0,299
Max 3 Jahre rollierend	106,9%	141,0%	135,6%	132,1%	168,1%	155,1%	154,9%	156,4%	168,7%	159,6%	162,0%
Min 3 Jahre rollierend	-62,1%	-25,4%	-32,0%	-62,2%	-49,0%	-54,4%	-62,4%	-62,3%	-53,0%	-59,3%	-80,4%
Max 5 Jahre rollierend	128,5%	230,8%	218,9%	189,8%	222,0%	221,0%	224,8%	216,5%	238,9%	187,0%	176,1%
Min 5 Jahre rollierend	-62,7%	-29,0%	-34,1%	-62,7%	-54,2%	-60,0%	-50,7%	-63,4%	-64,7%	-74,1%	-90,9%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	73,0%	80,7%	71,8%	73,8%	73,8%	69,4%	65,3%	53,6%	47,2%	32,3%

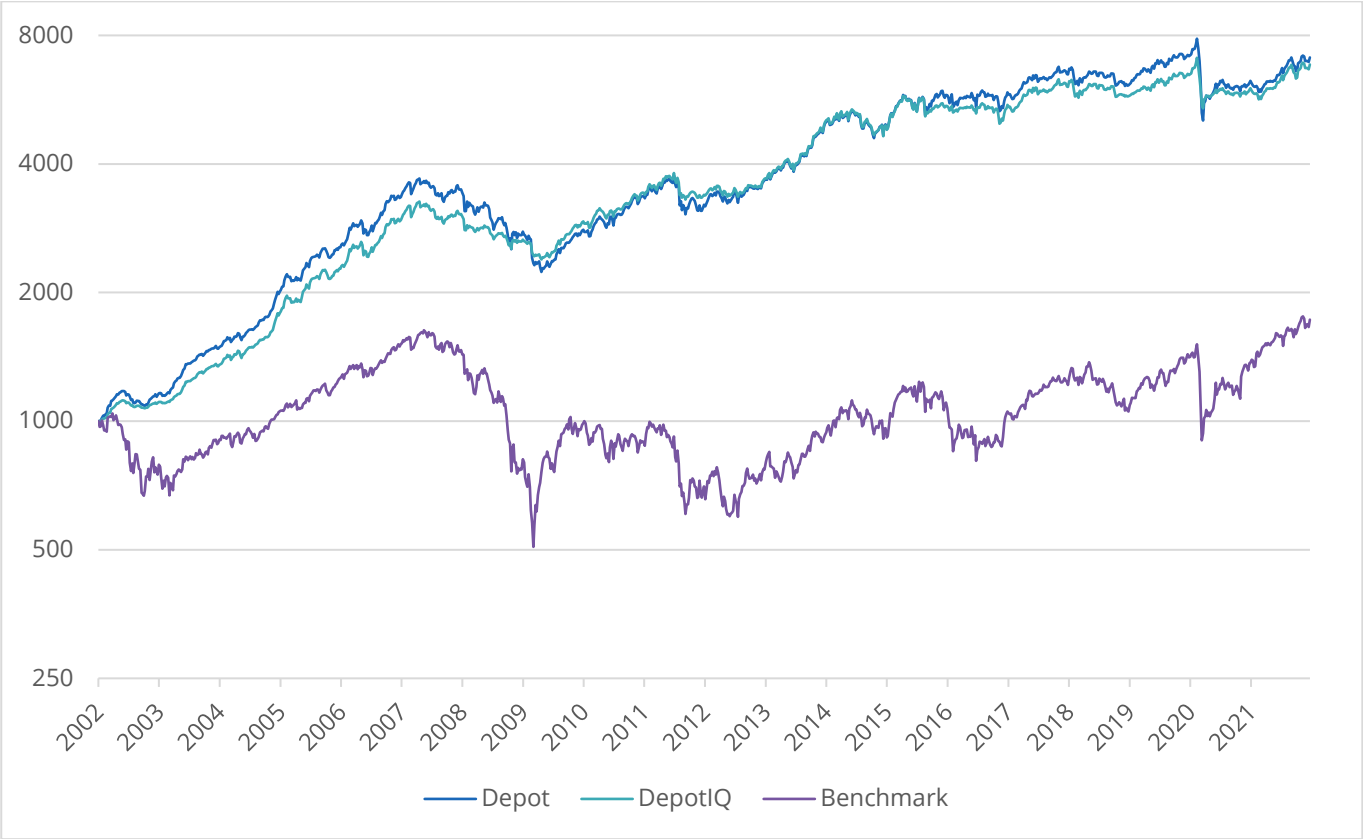


Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	10,3%	10,1%	2,8%
Annualisierte Volatilität	13,4%	10,7%	23,7%
Maximaler Drawdown	39,6%	26,8%	68,9%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,765	0,944	0,117

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Safety	80%
Verkaufskriterium 2	Safety	80%
Depotumschlagsfaktor	0,73	

Max 3 Jahre rollierend	143,8%	130,3%	106,9%
Min 3 Jahre rollierend	-25,1%	-11,2%	-62,1%
Max 5 Jahre rollierend	247,4%	213,1%	128,5%
Min 5 Jahre rollierend	-10,5%	-3,9%	-62,7%
Anteil Outperformance 1 Jahr	67,7%	65,3%	---



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	40,1%	37,5%	-4,1%
30.12.2002	bis	29.12.2003	9,9%	8,5%	16,3%
29.12.2003	bis	27.12.2004	16,2%	8,3%	-5,7%
27.12.2004	bis	26.12.2005	9,0%	9,3%	3,2%
26.12.2005	bis	25.12.2006	11,2%	13,9%	12,6%
25.12.2006	bis	31.12.2007	6,8%	5,2%	-21,3%
31.12.2007	bis	29.12.2008	25,6%	21,3%	-9,0%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-24,7%	-13,9%	17,0%
28.12.2009	bis	27.12.2010	29,0%	17,0%	-10,6%
27.12.2010	bis	26.12.2011	17,4%	10,2%	-19,2%
26.12.2011	bis	31.12.2012	3,6%	-3,4%	-18,8%
31.12.2012	bis	30.12.2013	15,2%	24,6%	22,2%
30.12.2013	bis	29.12.2014	-4,2%	0,3%	-9,2%
29.12.2014	bis	28.12.2015	2,4%	9,3%	-12,9%
28.12.2015	bis	26.12.2016	5,2%	9,0%	3,1%
26.12.2016	bis	25.12.2017	-6,1%	13,0%	-29,1%
25.12.2017	bis	31.12.2018	8,7%	7,6%	-11,6%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-16,7%	-14,2%	-5,4%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-10,3%	-3,0%	2,1%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-11,9%	-5,1%	-5,2%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	1,6%	23,9%	20,0%	15,5%	14,8%	9,2%	9,8%	8,7%	6,5%	2,5%	1,8%
27.12.2004	bis	28.12.2009	-1,4%	8,4%	7,7%	-4,3%	4,3%	3,1%	1,4%	3,1%	4,5%	1,1%	-11,5%
28.12.2009	bis	29.12.2014	-0,4%	10,0%	8,0%	8,3%	9,3%	6,8%	8,8%	2,0%	-1,0%	-2,1%	-18,4%
29.12.2014	bis	30.12.2019	7,9%	10,7%	15,8%	17,2%	10,0%	9,9%	7,6%	5,0%	4,9%	6,2%	-13,5%
30.12.2019	bis	27.12.2021	10,7%	3,0%	10,6%	7,2%	15,7%	17,4%	16,8%	6,7%	0,8%	1,3%	16,6%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	22,4%	6,6%	8,4%	9,5%	10,9%	13,8%	14,5%	18,1%	21,6%	23,7%	30,5%
27.12.2004	bis	28.12.2009	24,1%	12,3%	15,5%	18,3%	19,0%	21,6%	24,0%	25,6%	25,5%	26,5%	30,3%
28.12.2009	bis	29.12.2014	25,0%	13,4%	14,4%	17,1%	18,0%	19,5%	22,2%	25,2%	26,9%	29,2%	32,4%
29.12.2014	bis	30.12.2019	20,7%	12,6%	12,9%	14,7%	15,2%	17,2%	17,9%	19,6%	21,8%	22,9%	29,7%
30.12.2019	bis	27.12.2021	28,1%	19,6%	20,5%	22,4%	23,0%	24,0%	26,5%	28,5%	31,5%	34,5%	40,1%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	35,9%	7,8%	14,6%	18,2%	23,4%	32,5%	31,2%	32,8%	42,1%	42,5%	50,5%
27.12.2004	bis	28.12.2009	68,9%	33,7%	49,0%	69,2%	63,7%	67,6%	71,8%	72,3%	65,8%	69,4%	85,0%
28.12.2009	bis	29.12.2014	40,2%	25,0%	23,0%	32,3%	30,2%	35,6%	25,5%	48,3%	50,8%	58,9%	75,3%
29.12.2014	bis	30.12.2019	34,7%	10,7%	13,9%	17,4%	24,0%	27,0%	29,7%	32,0%	42,7%	36,2%	74,2%
30.12.2019	bis	27.12.2021	40,4%	34,6%	32,5%	35,7%	34,8%	37,0%	38,8%	41,9%	40,9%	43,4%	44,1%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	25,9%	21,1%	1,6%	6,6%	5,4%	22,4%	7,8%	4,2%	35,8%
27.12.2004	bis	28.12.2009	7,0%	10,5%	-1,4%	14,1%	10,7%	24,1%	39,6%	26,8%	68,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	12,1%	11,0%	-0,4%	13,3%	11,4%	25,0%	18,8%	13,4%	40,2%
29.12.2014	bis	30.12.2019	7,6%	5,5%	7,9%	12,9%	11,1%	20,7%	10,6%	14,0%	34,7%
30.12.2019	bis	27.12.2021	-0,4%	2,9%	10,7%	19,8%	13,3%	28,1%	35,7%	23,9%	40,4%

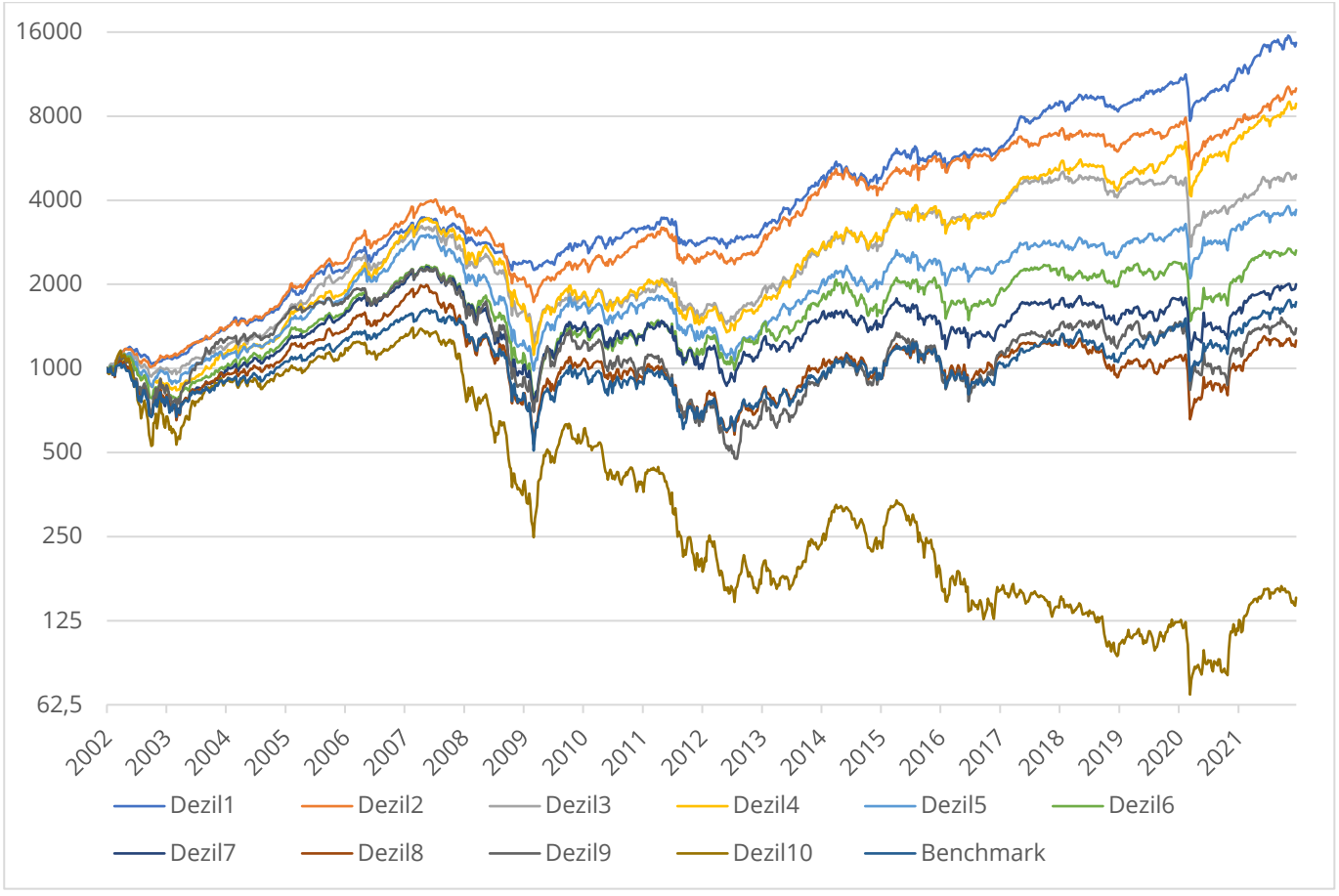
Technischer Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Italien + Spanien
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	FTSE MIB
Durchschnittliche Anzahl Aktien	208	Scoring-Modell:	Technischer Score

Dezilanalyse

	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	2,8%	14,3%	12,2%	8,3%	11,5%	6,7%	5,0%	3,5%	1,2%	1,7%	-9,0%
Annualisierte Volatilität	23,7%	15,0%	16,0%	18,6%	19,3%	18,7%	20,8%	21,4%	23,8%	25,7%	32,1%
Maximaler Drawdown	68,9%	35,3%	57,1%	62,3%	67,6%	67,3%	68,4%	69,6%	73,1%	79,2%	95,1%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,117	0,955	0,762	0,446	0,596	0,360	0,239	0,165	0,049	0,065	-0,280
Max 3 Jahre rollierend	106,9%	140,1%	169,3%	158,7%	196,8%	158,0%	139,2%	150,8%	130,9%	166,2%	131,2%
Min 3 Jahre rollierend	-62,1%	-21,4%	-41,2%	-50,1%	-52,6%	-52,0%	-58,7%	-59,6%	-64,7%	-63,5%	-79,9%
Max 5 Jahre rollierend	128,5%	219,9%	284,2%	221,2%	262,1%	212,0%	173,1%	206,5%	145,2%	191,9%	137,6%
Min 5 Jahre rollierend	-62,7%	-20,2%	-40,0%	-54,1%	-60,0%	-62,9%	-55,5%	-61,4%	-69,4%	-78,2%	-88,9%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	86,3%	73,0%	71,4%	82,7%	68,6%	67,7%	54,4%	48,4%	48,0%	21,0%

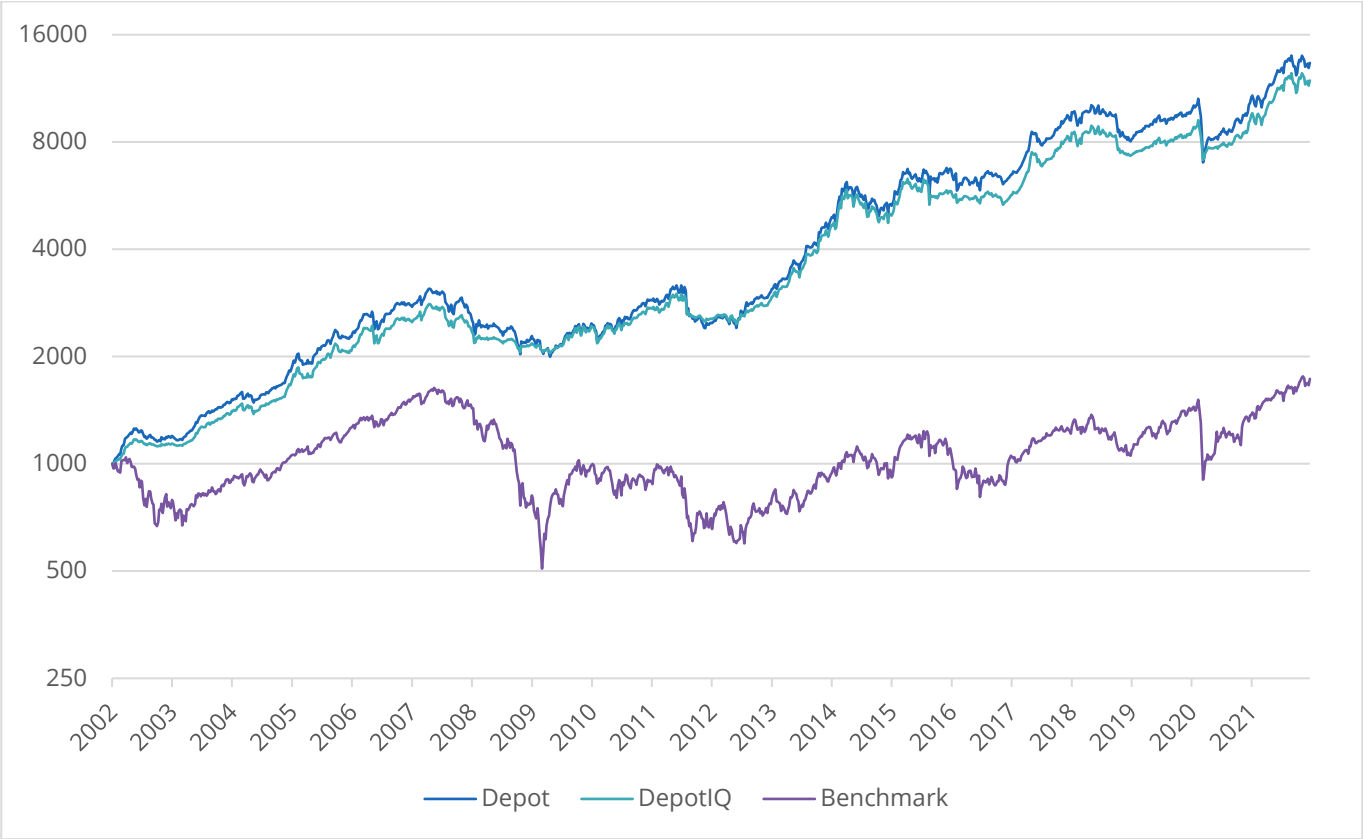


Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	13,8%	13,1%	2,8%
Annualisierte Volatilität	16,4%	13,7%	23,7%
Maximaler Drawdown	35,6%	27,3%	68,9%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,841	0,957	0,117

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Technisch	70%
Verkaufskriterium 2	Technisch	70%
Depotumschlagsfaktor	1,39	

Max 3 Jahre rollierend	169,9%	148,2%	106,9%
Min 3 Jahre rollierend	-23,6%	-16,3%	-62,1%
Max 5 Jahre rollierend	252,0%	201,0%	128,5%
Min 5 Jahre rollierend	-20,1%	-10,5%	-62,7%
Anteil Outperformance 1 Jahr	76,2%	75,0%	---



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	43,3%	33,7%	-3,7%
30.12.2002	bis	29.12.2003	7,2%	7,7%	30,2%
29.12.2003	bis	27.12.2004	4,1%	11,7%	-3,0%
27.12.2004	bis	26.12.2005	5,7%	10,1%	-4,5%
26.12.2005	bis	25.12.2006	3,4%	18,8%	-2,6%
25.12.2006	bis	31.12.2007	-4,1%	5,4%	-17,3%
31.12.2007	bis	29.12.2008	32,9%	15,7%	-10,0%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-19,0%	-11,1%	20,6%
28.12.2009	bis	27.12.2010	27,7%	24,8%	-13,8%
27.12.2010	bis	26.12.2011	9,3%	11,3%	-17,7%
26.12.2011	bis	31.12.2012	10,4%	-2,3%	-21,4%
31.12.2012	bis	30.12.2013	38,3%	37,1%	17,3%
30.12.2013	bis	29.12.2014	7,3%	-2,5%	-0,6%
29.12.2014	bis	28.12.2015	10,9%	9,5%	-16,5%
28.12.2015	bis	26.12.2016	1,0%	9,7%	-1,5%
26.12.2016	bis	25.12.2017	25,3%	12,0%	-12,5%
25.12.2017	bis	31.12.2018	1,8%	5,8%	-8,0%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-14,1%	-9,2%	-8,8%
30.12.2019	bis	28.12.2020	10,4%	9,8%	-8,8%
28.12.2020	bis	27.12.2021	2,6%	3,0%	-2,6%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	1,6%	20,6%	22,0%	15,4%	12,1%	11,3%	7,9%	6,3%	3,1%	14,8%	-1,2%
27.12.2004	bis	28.12.2009	-1,4%	9,7%	5,8%	3,0%	5,4%	4,1%	1,6%	3,2%	-0,8%	-4,5%	-10,6%
28.12.2009	bis	29.12.2014	-0,4%	11,5%	13,1%	9,2%	10,1%	3,9%	3,6%	0,5%	-2,0%	-5,0%	-15,1%
29.12.2014	bis	30.12.2019	7,9%	16,8%	10,6%	10,6%	15,9%	8,9%	8,1%	4,2%	2,9%	9,2%	-12,5%
30.12.2019	bis	27.12.2021	10,7%	18,2%	16,9%	3,7%	19,5%	8,8%	5,2%	6,4%	7,2%	-1,6%	10,7%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	22,4%	7,9%	9,4%	10,8%	12,9%	12,5%	14,7%	18,0%	19,8%	22,8%	30,0%
27.12.2004	bis	28.12.2009	24,1%	14,1%	16,8%	20,7%	22,7%	20,4%	22,5%	23,2%	25,4%	25,3%	29,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	25,0%	16,4%	16,7%	19,3%	19,3%	19,9%	22,6%	21,7%	25,1%	27,4%	33,5%
29.12.2014	bis	30.12.2019	20,7%	14,6%	14,8%	15,5%	16,6%	15,8%	17,5%	17,9%	19,7%	22,4%	30,5%
30.12.2019	bis	27.12.2021	28,1%	21,5%	22,0%	26,2%	23,6%	24,9%	26,7%	27,6%	30,4%	32,9%	40,0%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	35,9%	13,6%	14,2%	18,0%	23,6%	24,6%	33,5%	36,6%	38,8%	37,5%	54,4%
27.12.2004	bis	28.12.2009	68,9%	35,3%	57,1%	62,3%	67,6%	67,3%	68,4%	69,6%	73,1%	69,3%	82,2%
28.12.2009	bis	29.12.2014	40,2%	22,2%	26,1%	31,3%	35,5%	41,2%	33,6%	41,4%	46,6%	62,6%	76,2%
29.12.2014	bis	30.12.2019	34,7%	17,7%	17,7%	19,2%	22,8%	25,1%	29,6%	34,1%	33,0%	43,3%	72,3%
30.12.2019	bis	27.12.2021	40,4%	32,0%	34,9%	43,5%	36,1%	36,4%	38,2%	35,1%	41,2%	43,1%	46,0%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	22,2%	18,6%	1,6%	8,1%	6,7%	22,4%	8,1%	6,5%	35,8%
27.12.2004	bis	28.12.2009	5,9%	7,5%	-1,4%	15,1%	12,5%	24,1%	35,6%	27,3%	68,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	17,1%	16,0%	-0,4%	17,5%	15,5%	25,0%	24,1%	19,2%	40,2%
29.12.2014	bis	30.12.2019	12,4%	10,7%	7,9%	17,0%	14,1%	20,7%	20,9%	17,8%	34,7%
30.12.2019	bis	27.12.2021	17,7%	19,2%	10,7%	23,2%	18,3%	28,1%	33,7%	22,6%	40,4%

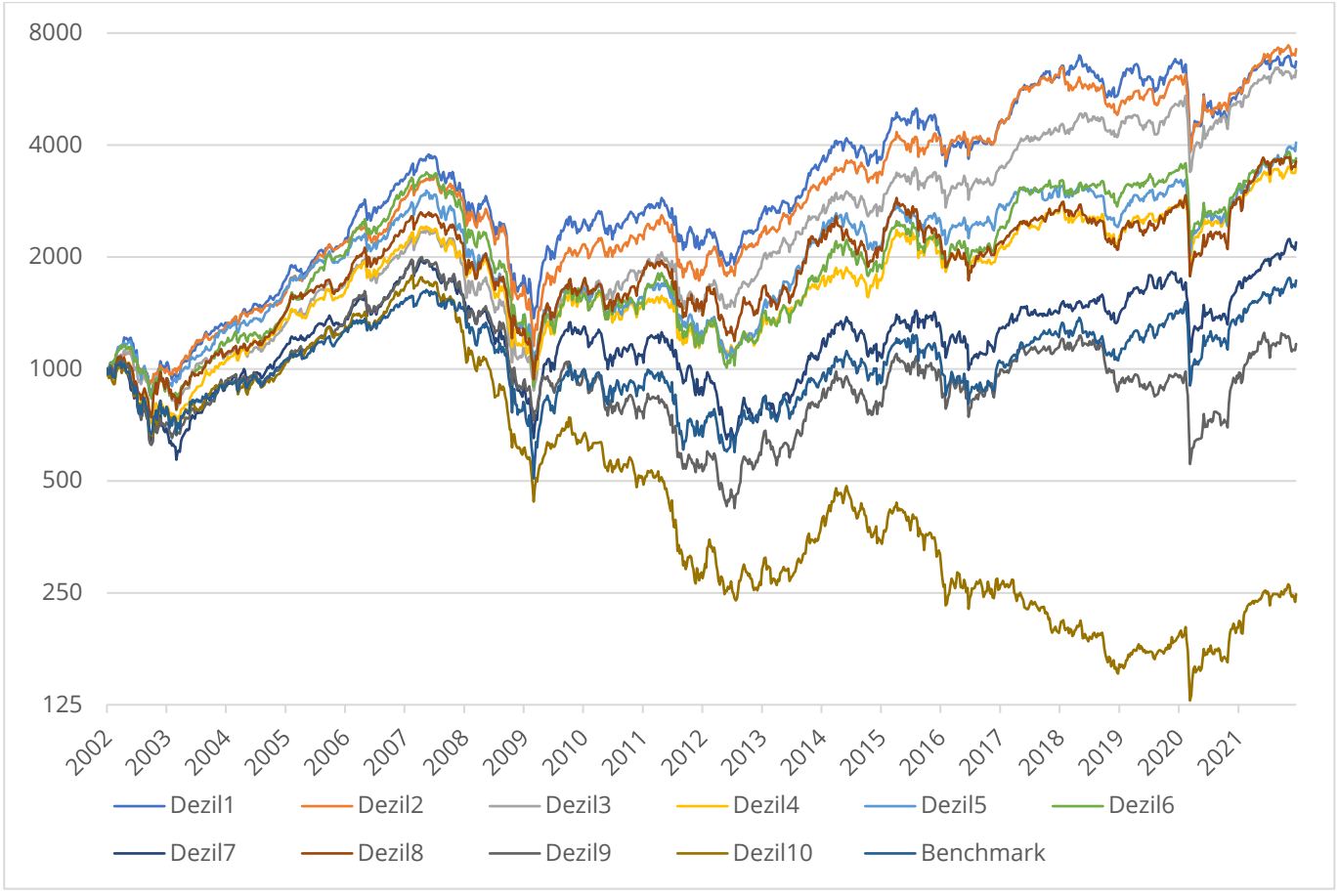
Value-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Italien + Spanien
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	FTSE MIB
Durchschnittliche Anzahl Aktien	199	Scoring-Modell:	Value-Score

Dezilanalyse

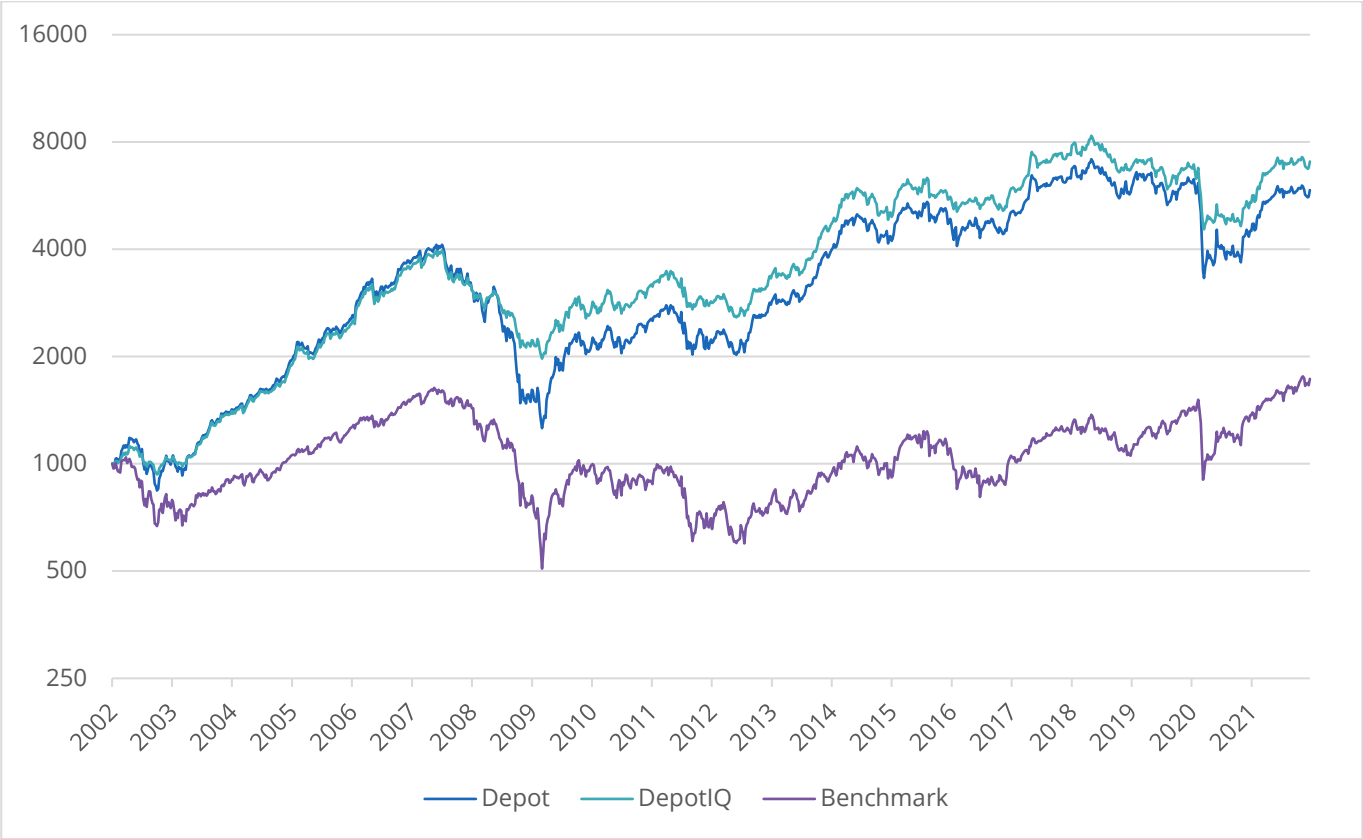
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	2,8%	10,0%	10,4%	9,7%	6,4%	7,3%	6,7%	4,0%	6,6%	0,8%	-6,7%
Annualisierte Volatilität	23,7%	20,6%	19,2%	19,2%	18,9%	19,5%	21,1%	21,3%	22,3%	22,7%	23,1%
Maximaler Drawdown	68,9%	63,8%	65,2%	62,9%	61,7%	65,9%	73,5%	68,6%	64,5%	78,9%	92,8%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,117	0,484	0,541	0,504	0,339	0,372	0,320	0,188	0,298	0,034	-0,291
Max 3 Jahre rollierend	106,9%	178,4%	141,3%	138,5%	154,7%	153,2%	183,2%	160,5%	151,8%	146,8%	105,9%
Min 3 Jahre rollierend	-62,1%	-47,2%	-51,1%	-53,0%	-49,9%	-53,6%	-61,9%	-56,3%	-52,4%	-60,5%	-69,1%
Max 5 Jahre rollierend	128,5%	284,9%	236,3%	219,0%	203,9%	214,6%	257,2%	172,3%	219,7%	175,8%	135,0%
Min 5 Jahre rollierend	-62,7%	-48,8%	-44,8%	-37,8%	-53,7%	-62,9%	-69,3%	-65,7%	-53,4%	-77,4%	-85,6%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	79,0%	78,6%	76,2%	67,7%	58,5%	67,7%	57,7%	62,9%	50,4%	30,7%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	9,2%	10,2%	2,8%
Annualisierte Volatilität	22,7%	17,1%	23,7%
Maximaler Drawdown	69,5%	50,3%	68,9%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,407	0,599	0,117
Max 3 Jahre rollierend	226,4%	203,7%	106,9%
Min 3 Jahre rollierend	-58,5%	-37,7%	-62,1%
Max 5 Jahre rollierend	319,6%	290,6%	128,5%
Min 5 Jahre rollierend	-50,2%	-34,4%	-62,7%
Anteil Outperformance 1 Jahr	71,8%	70,6%	---

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Value	90%
Verkaufskriterium 2	Value	90%
Depotumschlagsfaktor	0,85	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	24,5%	23,5%	-2,8%
30.12.2002	bis	29.12.2003	22,1%	13,3%	5,4%
29.12.2003	bis	27.12.2004	21,1%	8,2%	-4,0%
27.12.2004	bis	26.12.2005	11,2%	13,3%	6,3%
26.12.2005	bis	25.12.2006	24,3%	19,9%	12,3%
25.12.2006	bis	31.12.2007	-9,8%	-0,5%	-14,5%
31.12.2007	bis	29.12.2008	-6,3%	2,6%	-1,3%
29.12.2008	bis	28.12.2009	13,7%	12,6%	-19,8%
28.12.2009	bis	27.12.2010	29,4%	16,6%	-10,0%
27.12.2010	bis	26.12.2011	9,2%	4,2%	-13,6%
26.12.2011	bis	31.12.2012	16,2%	8,9%	-12,2%
31.12.2012	bis	30.12.2013	19,8%	19,8%	19,2%
30.12.2013	bis	29.12.2014	7,2%	2,2%	-6,7%
29.12.2014	bis	28.12.2015	-3,0%	5,3%	-6,7%
28.12.2015	bis	26.12.2016	8,7%	10,6%	-7,0%
26.12.2016	bis	25.12.2017	8,5%	19,0%	-20,4%
25.12.2017	bis	31.12.2018	5,4%	-1,2%	-8,4%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-26,5%	-10,3%	-16,4%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-24,3%	-10,2%	6,1%
28.12.2020	bis	27.12.2021	3,7%	-0,2%	-4,0%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	1,6%	19,8%	16,2%	9,2%	10,7%	17,4%	11,7%	4,1%	11,7%	1,0%	0,4%
27.12.2004	bis	28.12.2009	-1,4%	7,0%	6,3%	4,7%	2,8%	0,0%	2,1%	2,2%	3,6%	-2,2%	-8,5%
28.12.2009	bis	29.12.2014	-0,4%	9,0%	9,7%	10,8%	2,3%	5,8%	4,3%	-2,6%	5,0%	-2,5%	-11,7%
29.12.2014	bis	30.12.2019	7,9%	12,4%	12,4%	13,3%	9,4%	8,3%	12,3%	9,1%	5,4%	3,4%	-11,4%
30.12.2019	bis	27.12.2021	10,7%	0,2%	9,1%	11,4%	12,7%	12,9%	4,0%	13,1%	14,5%	10,3%	14,4%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	22,4%	15,1%	12,3%	15,8%	15,2%	16,2%	16,8%	18,2%	19,6%	17,9%	18,5%
27.12.2004	bis	28.12.2009	24,1%	23,3%	22,6%	21,6%	20,4%	20,9%	22,8%	20,9%	22,5%	20,1%	20,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	25,0%	19,4%	18,4%	19,0%	20,3%	20,1%	23,7%	23,8%	23,4%	24,7%	25,8%
29.12.2014	bis	30.12.2019	20,7%	18,5%	16,7%	16,0%	16,5%	16,8%	16,6%	19,2%	18,3%	20,9%	22,7%
30.12.2019	bis	27.12.2021	28,1%	27,7%	25,5%	24,5%	22,1%	24,7%	25,0%	24,6%	30,4%	32,4%	28,3%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	35,9%	28,8%	18,6%	31,0%	32,2%	28,6%	28,3%	46,2%	31,6%	41,0%	35,7%
27.12.2004	bis	28.12.2009	68,9%	63,8%	65,2%	62,9%	61,7%	65,9%	73,5%	66,8%	64,5%	63,6%	75,3%
28.12.2009	bis	29.12.2014	40,2%	34,3%	33,3%	30,7%	34,6%	37,2%	44,3%	52,6%	39,3%	57,6%	64,6%
29.12.2014	bis	30.12.2019	34,7%	30,1%	25,9%	22,0%	26,2%	23,5%	24,7%	30,8%	40,0%	32,4%	65,3%
30.12.2019	bis	27.12.2021	40,4%	40,4%	38,3%	37,5%	32,8%	37,7%	38,6%	36,5%	39,6%	43,7%	36,6%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	25,0%	23,7%	1,6%	16,4%	10,8%	22,4%	28,9%	16,7%	35,8%
27.12.2004	bis	28.12.2009	1,5%	7,0%	-1,4%	26,0%	18,3%	24,1%	69,4%	50,3%	68,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	15,6%	13,8%	-0,4%	20,6%	17,2%	25,0%	27,4%	25,9%	40,2%
29.12.2014	bis	30.12.2019	7,3%	6,1%	7,9%	19,4%	16,1%	20,7%	25,7%	29,3%	34,7%
30.12.2019	bis	27.12.2021	-2,8%	1,7%	10,7%	32,4%	23,0%	28,1%	47,2%	34,4%	40,4%

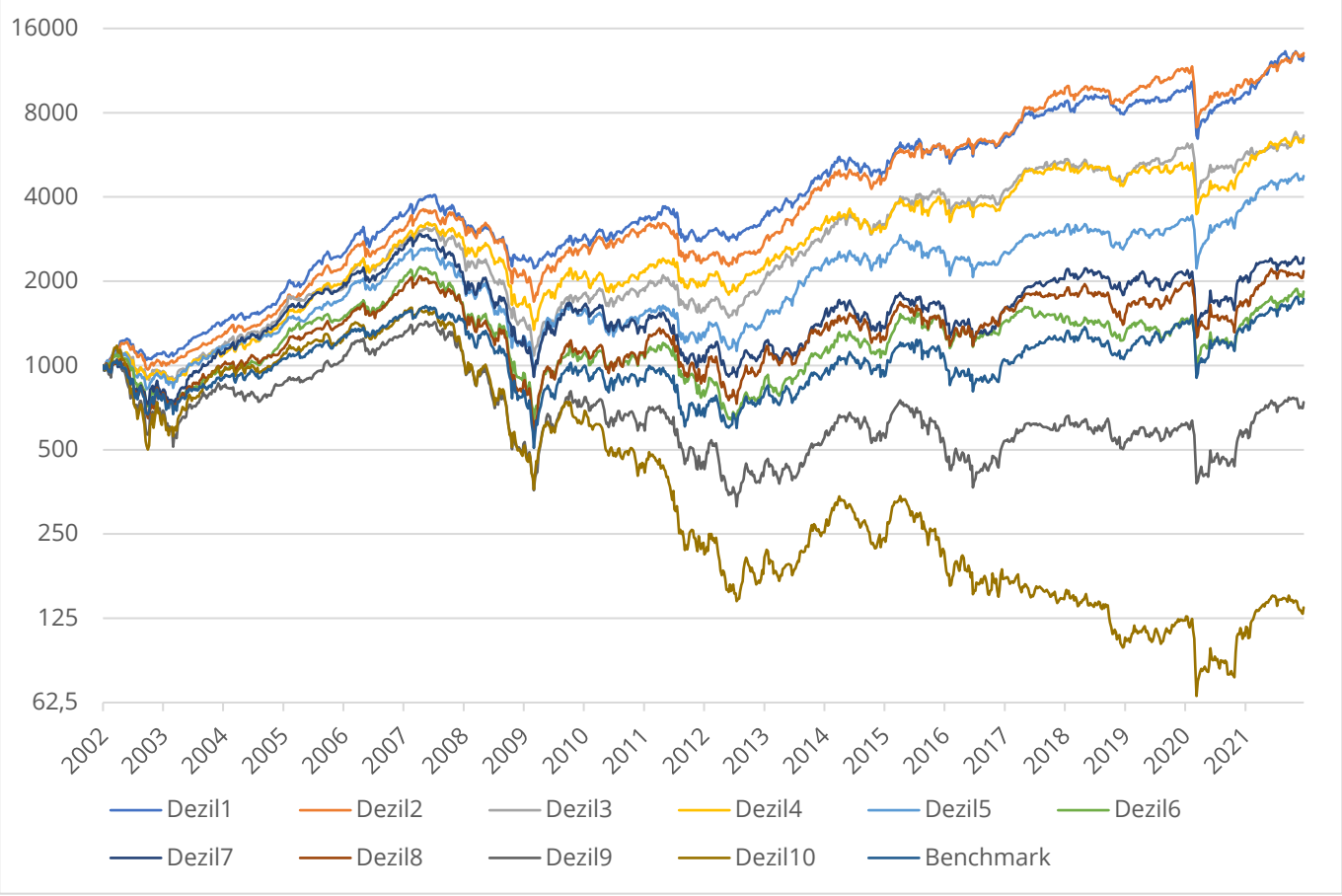
Kombi-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Italien + Spanien
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	FTSE MIB
Durchschnittliche Anzahl Aktien	199	Scoring-Modell:	Kombi-Score

Dezilanalyse

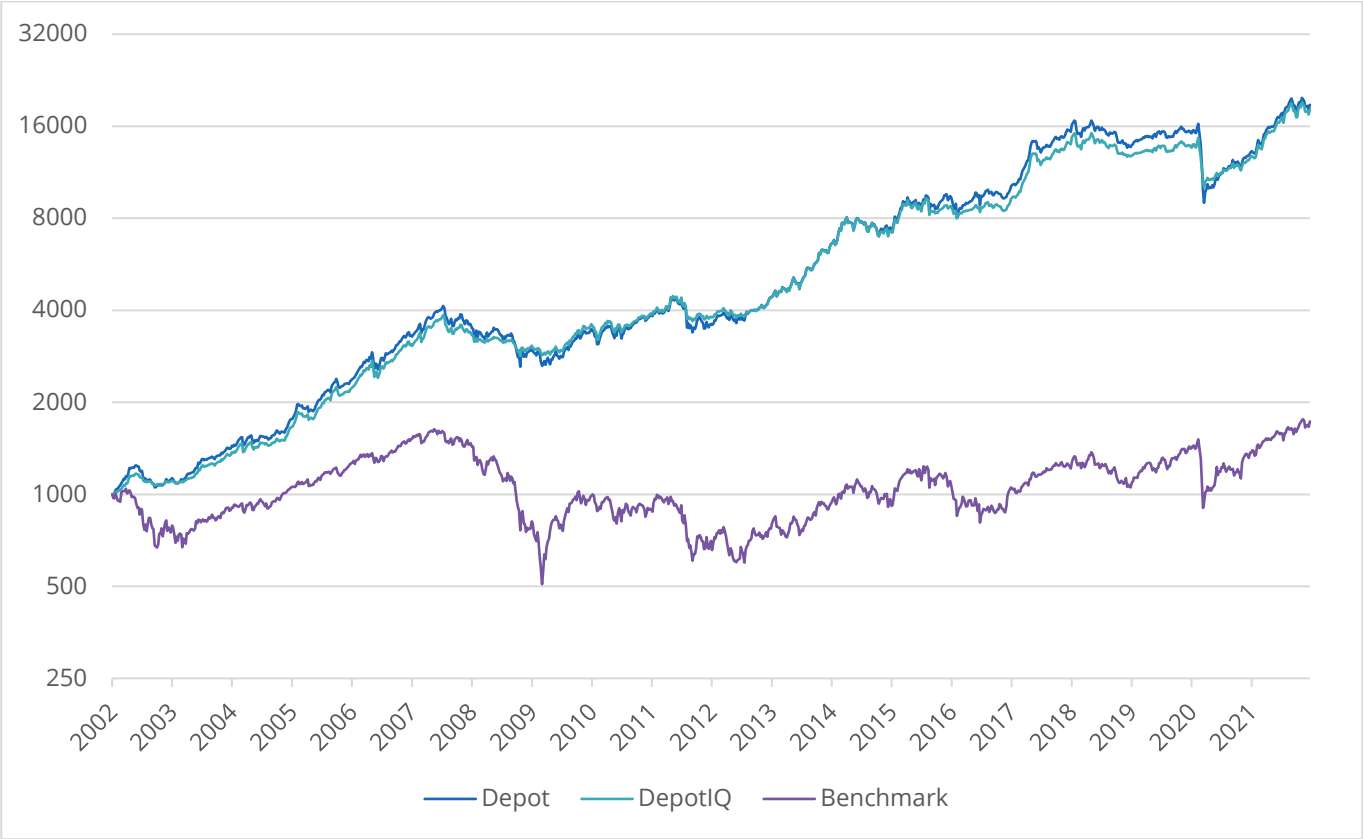
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	2,8%	13,5%	13,7%	9,9%	9,7%	8,1%	3,1%	4,5%	4,0%	-1,5%	-9,5%
Annualisierte Volatilität	23,7%	16,1%	17,2%	17,7%	17,7%	19,2%	20,8%	21,7%	23,6%	26,4%	30,1%
Maximaler Drawdown	68,9%	45,4%	53,3%	65,1%	58,7%	64,8%	71,5%	69,1%	73,1%	78,2%	95,9%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,117	0,837	0,795	0,561	0,550	0,422	0,148	0,208	0,168	-0,057	-0,315
Max 3 Jahre rollierend	106,9%	171,9%	171,7%	169,2%	173,2%	147,1%	142,3%	196,0%	126,6%	134,8%	158,2%
Min 3 Jahre rollierend	-62,1%	-30,5%	-35,5%	-50,7%	-42,7%	-52,7%	-59,9%	-57,0%	-64,2%	-69,9%	-77,5%
Max 5 Jahre rollierend	128,5%	267,0%	282,7%	237,0%	234,6%	181,9%	171,7%	249,1%	190,9%	127,2%	179,0%
Min 5 Jahre rollierend	-62,7%	-30,5%	-35,6%	-51,0%	-43,5%	-55,7%	-70,1%	-68,2%	-62,1%	-76,8%	-90,4%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	80,7%	84,3%	73,4%	75,4%	69,4%	56,1%	62,1%	58,5%	35,9%	24,2%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	15,7%	15,5%	2,8%
Annualisierte Volatilität	17,2%	14,0%	23,7%
Maximaler Drawdown	46,1%	33,5%	68,9%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,918	1,114	0,117
Max 3 Jahre rollierend	167,6%	162,4%	106,9%
Min 3 Jahre rollierend	-29,4%	-17,4%	-62,1%
Max 5 Jahre rollierend	294,3%	250,7%	128,5%
Min 5 Jahre rollierend	-9,6%	-0,5%	-62,7%
Anteil Outperformance 1 Jahr	84,3%	79,8%	---

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Kombi	70%
Verkaufskriterium 2	Kombi	70%
Depotumschlagsfaktor	0,91	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	36,6%	29,6%	-11,8%
30.12.2002	bis	29.12.2003	8,1%	8,9%	20,8%
29.12.2003	bis	27.12.2004	6,3%	11,1%	-8,6%
27.12.2004	bis	26.12.2005	13,6%	15,9%	-2,1%
26.12.2005	bis	25.12.2006	21,7%	18,9%	3,3%
25.12.2006	bis	31.12.2007	11,0%	6,6%	-16,3%
31.12.2007	bis	29.12.2008	29,5%	14,2%	-9,9%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-11,0%	-4,9%	14,1%
28.12.2009	bis	27.12.2010	20,9%	24,7%	-13,4%
27.12.2010	bis	26.12.2011	16,6%	5,1%	-14,3%
26.12.2011	bis	31.12.2012	10,4%	2,8%	-28,6%
31.12.2012	bis	30.12.2013	28,2%	34,7%	17,2%
30.12.2013	bis	29.12.2014	10,1%	-0,3%	-3,0%
29.12.2014	bis	28.12.2015	12,1%	12,1%	-20,8%
28.12.2015	bis	26.12.2016	10,3%	12,4%	-7,8%
26.12.2016	bis	25.12.2017	37,6%	19,0%	-17,6%
25.12.2017	bis	31.12.2018	3,2%	8,1%	-10,0%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-21,9%	-8,4%	-11,5%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-11,6%	-3,0%	-4,7%
28.12.2020	bis	27.12.2021	17,3%	5,0%	-1,0%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	1,6%	22,1%	17,9%	15,8%	12,3%	11,1%	6,7%	14,3%	4,4%	-5,3%	2,5%
27.12.2004	bis	28.12.2009	-1,4%	9,3%	10,2%	2,8%	8,1%	2,4%	-2,3%	1,6%	-0,1%	-3,1%	-10,2%
28.12.2009	bis	29.12.2014	-0,4%	11,7%	11,8%	12,5%	8,5%	9,2%	0,8%	-3,0%	2,3%	-4,6%	-17,4%
29.12.2014	bis	30.12.2019	7,9%	14,2%	19,5%	13,2%	10,0%	6,7%	5,3%	8,9%	9,1%	1,4%	-12,6%
30.12.2019	bis	27.12.2021	10,7%	15,1%	7,2%	5,5%	12,7%	19,8%	12,2%	6,9%	5,1%	9,7%	5,5%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	22,4%	9,8%	10,9%	12,4%	12,9%	12,9%	15,2%	18,8%	19,8%	26,8%	28,9%
27.12.2004	bis	28.12.2009	24,1%	16,5%	19,2%	19,3%	19,8%	20,8%	23,7%	22,0%	25,6%	26,0%	25,6%
28.12.2009	bis	29.12.2014	25,0%	16,7%	17,5%	18,3%	17,4%	20,9%	22,2%	22,6%	25,1%	27,2%	31,8%
29.12.2014	bis	30.12.2019	20,7%	15,1%	14,7%	15,5%	15,9%	16,6%	17,2%	18,6%	19,6%	23,5%	28,5%
30.12.2019	bis	27.12.2021	28,1%	22,8%	23,9%	22,9%	22,9%	24,0%	24,5%	29,0%	28,5%	31,8%	40,3%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	35,9%	16,0%	20,5%	20,8%	21,4%	26,7%	34,9%	30,1%	38,8%	51,4%	57,4%
27.12.2004	bis	28.12.2009	68,9%	45,4%	53,3%	65,1%	58,7%	64,8%	71,4%	69,1%	73,1%	75,1%	77,6%
28.12.2009	bis	29.12.2014	40,2%	25,1%	29,9%	29,6%	25,9%	31,2%	46,9%	45,3%	46,2%	59,3%	79,1%
29.12.2014	bis	30.12.2019	34,7%	18,2%	13,3%	18,2%	18,7%	29,3%	25,7%	34,8%	30,3%	51,1%	71,2%
30.12.2019	bis	27.12.2021	40,4%	37,5%	39,4%	35,9%	34,3%	35,5%	34,5%	39,3%	37,6%	40,4%	48,1%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	20,8%	18,4%	1,6%	10,2%	8,4%	22,4%	15,4%	8,4%	35,8%
27.12.2004	bis	28.12.2009	14,2%	16,5%	-1,4%	16,8%	13,2%	24,1%	36,6%	26,5%	68,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	16,8%	15,4%	-0,4%	17,3%	14,9%	25,0%	23,1%	17,4%	40,2%
29.12.2014	bis	30.12.2019	15,4%	13,5%	7,9%	16,2%	13,9%	20,7%	18,4%	16,3%	34,7%
30.12.2019	bis	27.12.2021	10,8%	14,8%	10,7%	26,2%	19,3%	28,1%	44,9%	31,1%	40,4%

USA – Nasdaq 100

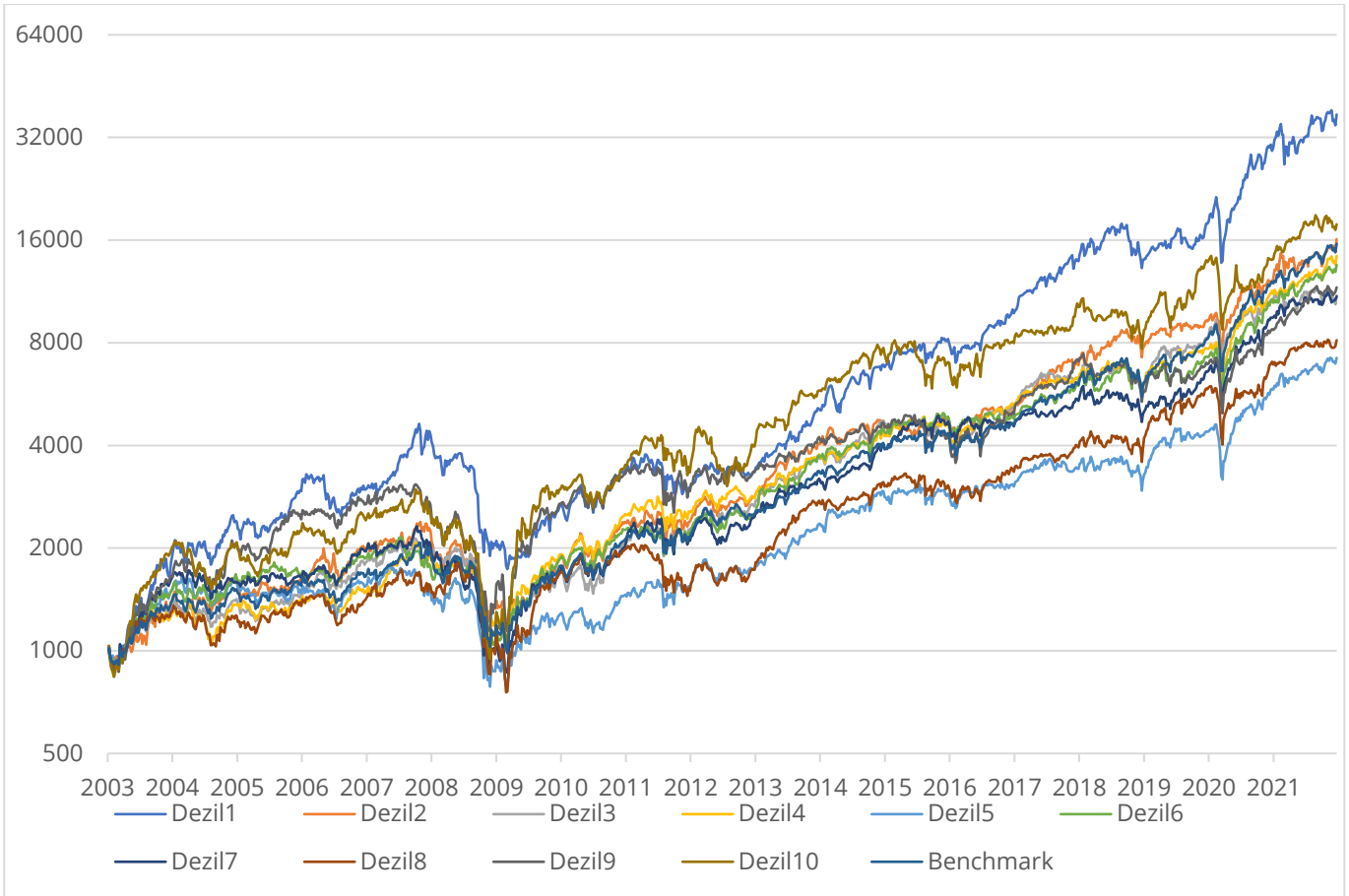
Trend-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	06.01.2003	Region:	USA (Nasdaq100)
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	Nasdaq100
Durchschnittliche Anzahl Aktien	101	Scoring-Modell:	Trend-Score

Dezilanalyse

	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	15,5%	21,0%	15,7%	13,4%	15,0%	11,0%	14,7%	13,4%	11,6%	13,8%	16,3%
Annualisierte Volatilität	20,7%	26,0%	22,4%	21,4%	21,2%	21,8%	22,1%	21,8%	23,7%	26,4%	28,6%
Maximaler Drawdown	52,6%	62,5%	50,4%	53,2%	47,3%	55,7%	52,9%	62,8%	58,2%	63,0%	68,2%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,749	0,807	0,701	0,628	0,711	0,502	0,662	0,613	0,491	0,521	0,571
Max 3 Jahre rollierend	164,9%	253,4%	130,0%	144,2%	145,9%	135,8%	143,7%	175,6%	136,4%	195,6%	323,2%
Min 3 Jahre rollierend	-36,9%	-44,6%	-32,5%	-35,1%	-21,7%	-49,1%	-41,7%	-48,8%	-47,7%	-55,1%	-57,0%
Max 5 Jahre rollierend	251,4%	379,0%	280,6%	278,4%	234,8%	222,4%	286,2%	270,5%	267,5%	275,4%	502,2%
Min 5 Jahre rollierend	-25,4%	-26,4%	-10,6%	-19,5%	-12,1%	-49,8%	-31,7%	-47,3%	-39,8%	-36,4%	-50,8%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	70,6%	50,2%	43,4%	45,5%	32,8%	47,2%	41,3%	36,6%	41,7%	50,2%

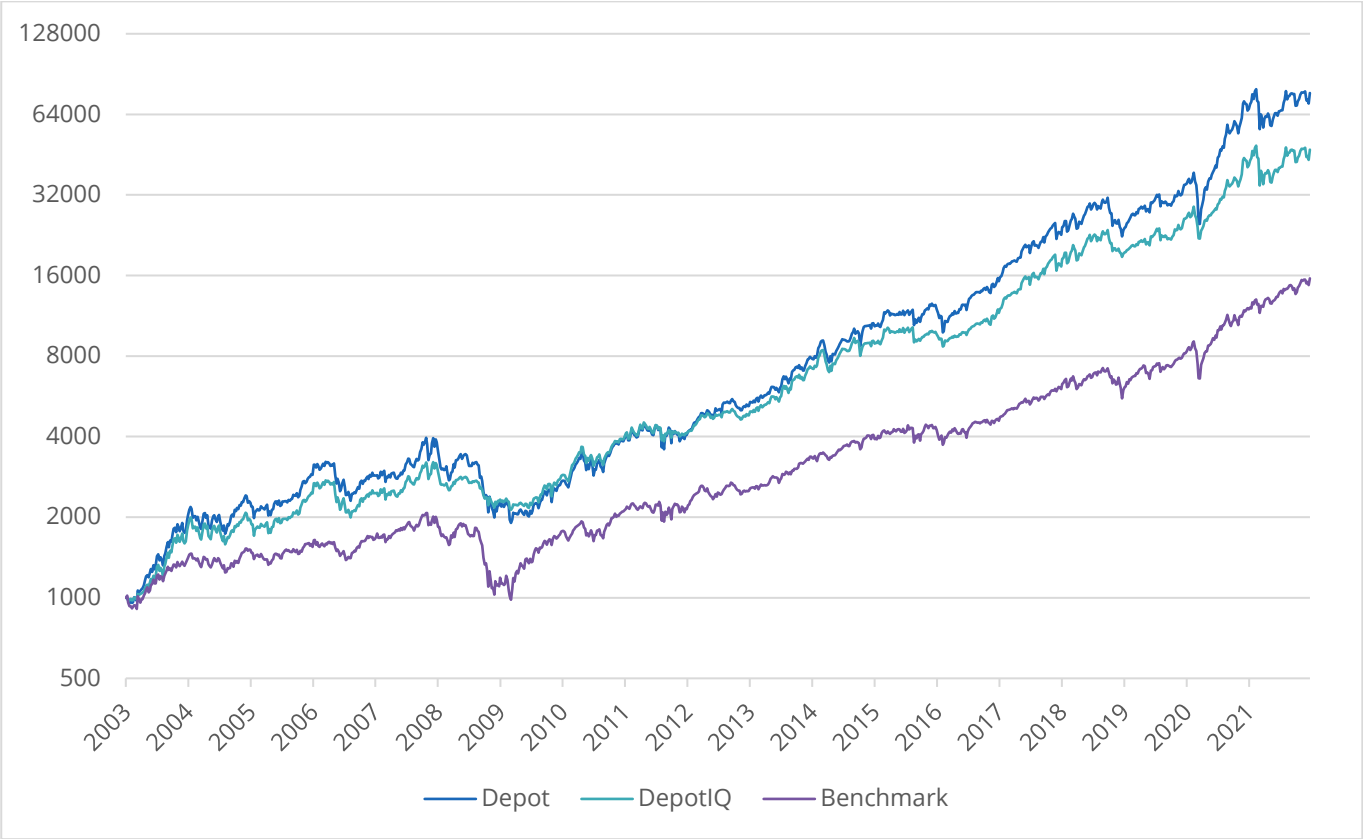


Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	25,6%	22,4%	15,5%
Annualisierte Volatilität	27,6%	23,2%	20,7%
Maximaler Drawdown	51,9%	33,5%	52,6%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,928	0,966	0,749

Max 3 Jahre rollierend	230,5%	173,5%	164,9%
Min 3 Jahre rollierend	-39,1%	-21,1%	-36,9%
Max 5 Jahre rollierend	685,8%	448,4%	251,4%
Min 5 Jahre rollierend	0,0%	14,4%	-25,4%
Anteil Outperformance 1 Jahr	81,7%	73,6%	---

Anzahl Aktien im Depot	8	
Verkaufskriterium 1	Trend	70%
Verkaufskriterium 2	Trend	70%
Depotumschlagsfaktor	1,71	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
06.01.2003	bis	29.12.2003	56,3%	21,8%	43,0%
29.12.2003	bis	27.12.2004	8,4%	15,0%	4,5%
27.12.2004	bis	26.12.2005	21,5%	6,9%	11,3%
26.12.2005	bis	25.12.2006	-5,1%	7,7%	3,9%
25.12.2006	bis	31.12.2007	14,1%	9,9%	-17,7%
31.12.2007	bis	29.12.2008	1,8%	-3,2%	-9,3%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-37,6%	-24,7%	74,6%
28.12.2009	bis	27.12.2010	23,2%	7,7%	0,2%
27.12.2010	bis	26.12.2011	2,8%	-7,2%	-7,1%
26.12.2011	bis	31.12.2012	12,1%	-1,9%	-2,3%
31.12.2012	bis	30.12.2013	17,0%	14,9%	1,9%
30.12.2013	bis	29.12.2014	14,0%	4,8%	0,9%
29.12.2014	bis	28.12.2015	9,9%	3,5%	-16,0%
28.12.2015	bis	26.12.2016	19,3%	7,5%	9,3%
26.12.2016	bis	25.12.2017	16,3%	6,2%	5,3%
25.12.2017	bis	31.12.2018	4,3%	7,3%	-19,1%
31.12.2018	bis	30.12.2019	10,5%	-13,4%	7,6%
30.12.2019	bis	28.12.2020	41,7%	-0,4%	-33,3%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-12,7%	1,5%	0,8%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003	bis	27.12.2004	23,3%	55,6%	27,5%	18,7%	17,2%	26,7%	29,8%	26,5%	12,8%	43,6%	43,9%
27.12.2004	bis	28.12.2009	3,2%	1,9%	3,0%	3,8%	6,9%	-4,4%	2,0%	1,3%	5,8%	5,6%	7,6%
28.12.2009	bis	29.12.2014	18,0%	21,1%	20,3%	22,7%	18,0%	18,1%	19,3%	18,8%	13,1%	11,6%	21,0%
29.12.2014	bis	30.12.2019	15,0%	20,9%	14,3%	11,6%	11,8%	8,3%	10,0%	10,2%	13,4%	8,2%	12,2%
30.12.2019	bis	27.12.2021	37,9%	44,6%	31,9%	15,7%	36,8%	28,4%	36,4%	29,0%	17,9%	29,6%	13,6%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003	bis	27.12.2004	21,0%	29,5%	24,9%	21,8%	23,1%	22,6%	22,1%	22,9%	25,2%	26,8%	26,6%
27.12.2004	bis	28.12.2009	24,4%	27,7%	24,7%	22,9%	24,6%	27,4%	27,5%	26,3%	30,2%	35,8%	37,0%
28.12.2009	bis	29.12.2014	17,4%	21,8%	20,6%	20,7%	18,9%	17,6%	18,8%	19,1%	19,3%	21,2%	23,3%
29.12.2014	bis	30.12.2019	18,0%	21,0%	17,9%	17,0%	17,7%	17,7%	17,5%	17,7%	19,0%	19,7%	24,7%
30.12.2019	bis	27.12.2021	24,5%	36,4%	27,9%	27,7%	23,2%	24,0%	25,1%	24,3%	24,8%	24,8%	27,8%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003	bis	27.12.2004	15,1%	15,3%	18,9%	16,6%	23,6%	17,9%	15,3%	17,4%	24,2%	17,5%	27,7%
27.12.2004	bis	28.12.2009	52,6%	62,5%	50,4%	53,2%	47,3%	55,7%	52,9%	62,8%	58,2%	63,0%	68,2%
28.12.2009	bis	29.12.2014	15,7%	23,5%	18,7%	19,2%	21,3%	16,8%	17,1%	21,4%	29,5%	28,0%	32,9%
29.12.2014	bis	30.12.2019	22,9%	26,0%	17,3%	22,3%	22,2%	20,6%	18,3%	21,5%	18,7%	27,7%	28,7%
30.12.2019	bis	27.12.2021	27,2%	35,7%	23,0%	28,3%	25,5%	31,2%	29,7%	26,7%	32,5%	31,4%	39,2%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
06.01.2003	bis	27.12.2004	52,1%	41,0%	23,3%	29,1%	27,4%	21,0%	20,6%	20,6%	15,1%
27.12.2004	bis	28.12.2009	3,4%	7,6%	3,2%	28,1%	22,4%	24,4%	51,9%	33,5%	52,6%
28.12.2009	bis	29.12.2014	31,2%	26,1%	18,0%	24,2%	19,5%	17,4%	19,3%	17,3%	15,7%
29.12.2014	bis	30.12.2019	26,8%	23,3%	15,0%	23,3%	20,3%	18,0%	28,5%	20,7%	22,9%
30.12.2019	bis	27.12.2021	48,3%	34,6%	37,9%	39,9%	34,1%	24,5%	35,7%	29,0%	27,2%

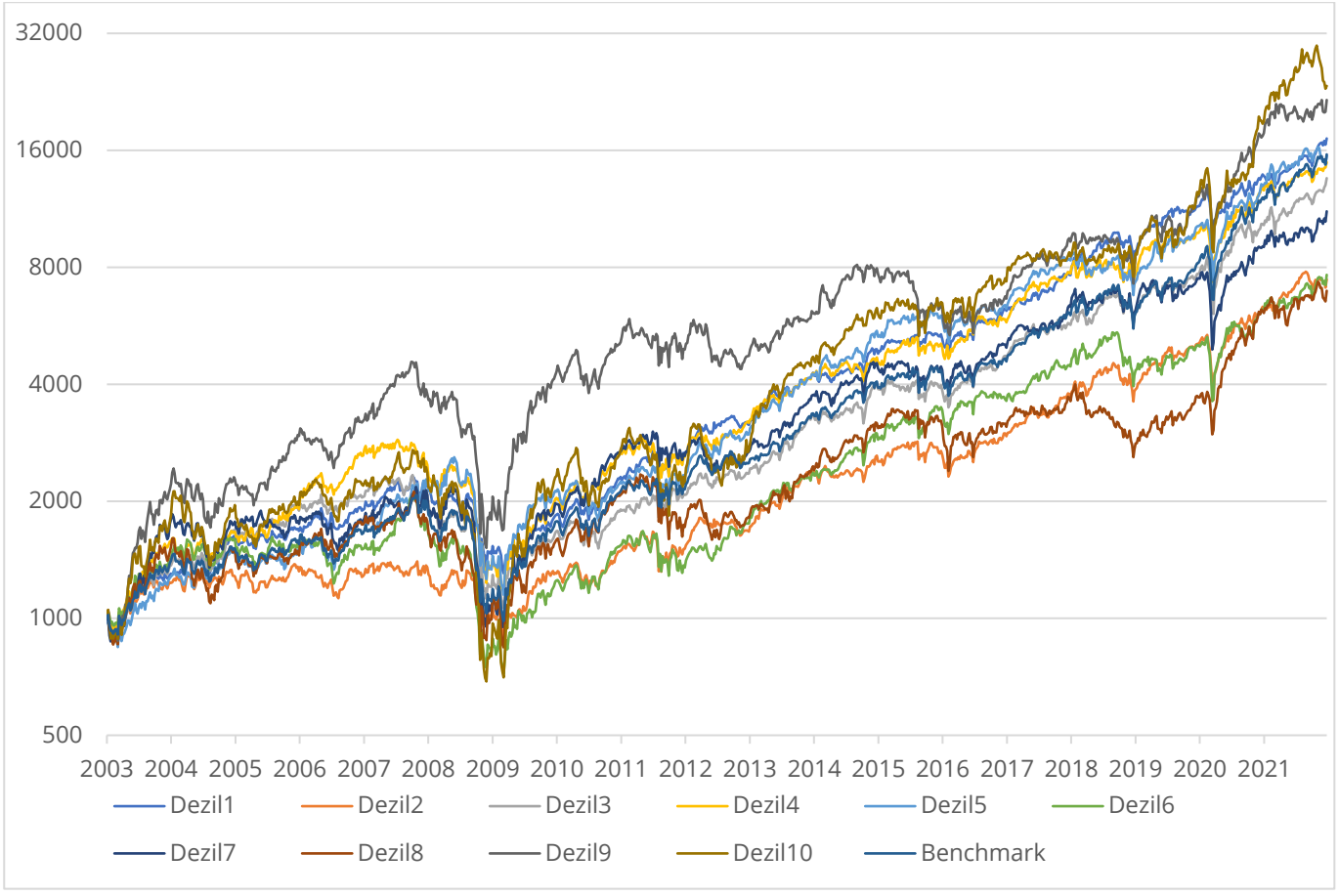
Safety-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	06.01.2003	Region:	USA (Nasdaq100)
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	Nasdaq100
Durchschnittliche Anzahl Aktien	101	Scoring-Modell:	Safety-Score

Dezilanalyse

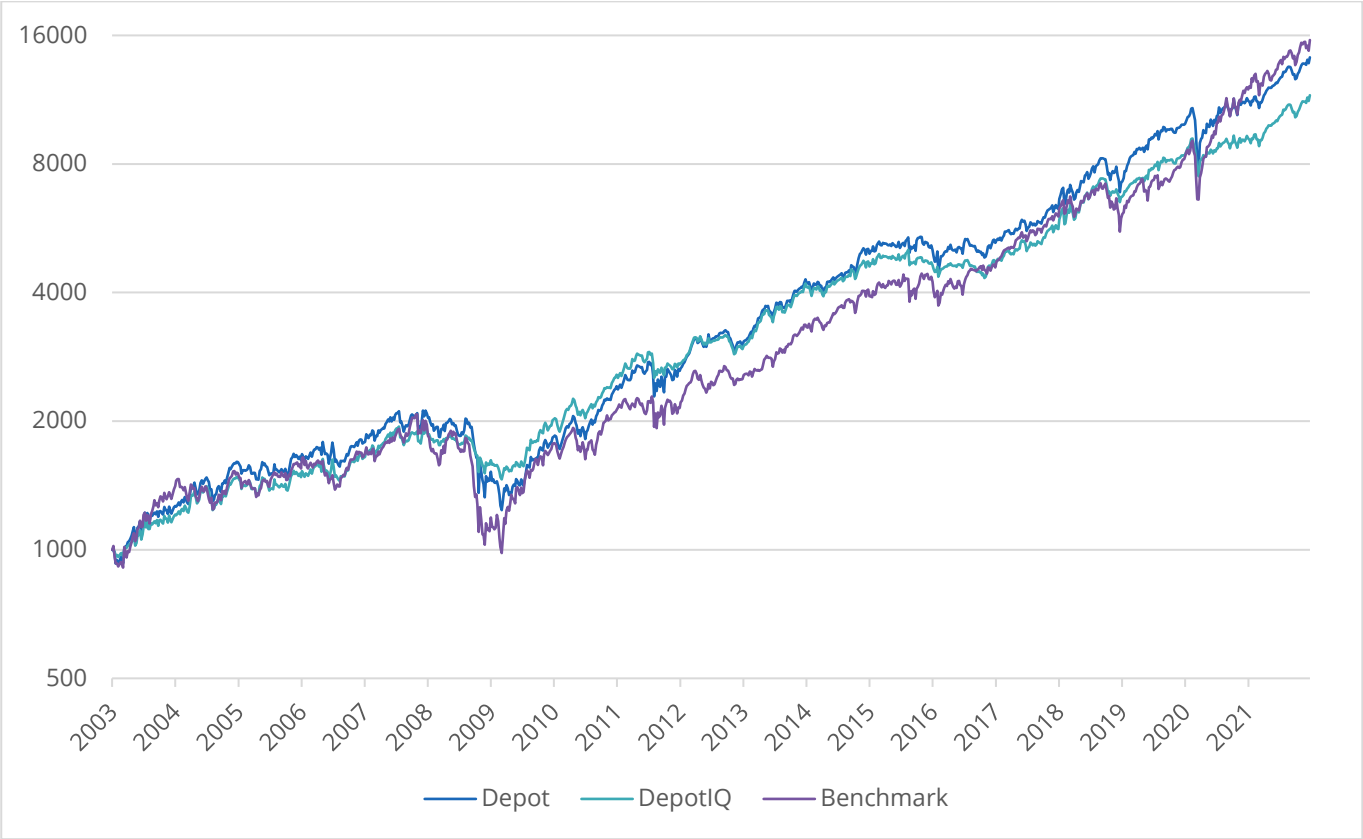
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	15,5%	16,1%	11,1%	14,7%	15,3%	15,5%	11,3%	13,5%	10,7%	17,5%	18,0%
Annualisierte Volatilität	20,7%	17,6%	19,0%	19,3%	20,4%	21,6%	22,9%	25,0%	26,3%	28,2%	32,1%
Maximaler Drawdown	52,6%	43,5%	37,4%	54,6%	59,1%	55,8%	65,2%	56,8%	60,3%	66,8%	74,6%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,749	0,917	0,586	0,760	0,748	0,718	0,493	0,539	0,408	0,621	0,561
Max 3 Jahre rollierend	164,9%	124,8%	96,6%	127,5%	145,5%	141,2%	135,4%	201,4%	156,6%	240,2%	339,4%
Min 3 Jahre rollierend	-36,9%	-26,3%	-34,0%	-44,8%	-45,8%	-24,4%	-53,8%	-48,5%	-46,0%	-46,3%	-67,5%
Max 5 Jahre rollierend	251,4%	223,5%	178,1%	215,8%	274,7%	305,2%	237,2%	302,6%	224,6%	327,7%	624,6%
Min 5 Jahre rollierend	-25,4%	-0,3%	-25,6%	-23,1%	-19,3%	-5,9%	-50,5%	-45,2%	-41,7%	-26,7%	-62,9%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	60,0%	29,8%	50,6%	50,2%	57,9%	32,3%	36,2%	43,8%	54,5%	54,5%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	14,9%	13,7%	15,5%
Annualisierte Volatilität	18,3%	14,0%	20,7%
Maximaler Drawdown	41,5%	24,8%	52,6%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,819	0,983	0,749
Max 3 Jahre rollierend	138,2%	106,8%	164,9%
Min 3 Jahre rollierend	-26,7%	-6,4%	-36,9%
Max 5 Jahre rollierend	236,4%	178,3%	251,4%
Min 5 Jahre rollierend	-6,5%	11,4%	-25,4%
Anteil Outperformance 1 Jahr	54,0%	46,8%	---

Anzahl Aktien im Depot	8	
Verkaufskriterium 1	Safety	80%
Verkaufskriterium 2	Safety	80%
Depotumschlagsfaktor	0,89	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
06.01.2003	bis	29.12.2003	-12,8%	-11,9%	57,5%
29.12.2003	bis	27.12.2004	18,6%	5,5%	-1,6%
27.12.2004	bis	26.12.2005	-2,0%	0,2%	11,7%
26.12.2005	bis	25.12.2006	3,5%	-1,2%	5,3%
25.12.2006	bis	31.12.2007	-1,6%	-8,5%	-6,4%
31.12.2007	bis	29.12.2008	13,3%	14,1%	-15,7%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-33,9%	-31,9%	101,9%
28.12.2009	bis	27.12.2010	10,9%	0,1%	-1,7%
27.12.2010	bis	26.12.2011	8,9%	6,6%	-10,1%
26.12.2011	bis	31.12.2012	-2,4%	-1,8%	-9,6%
31.12.2012	bis	30.12.2013	8,3%	6,3%	17,3%
30.12.2013	bis	29.12.2014	-2,9%	-9,2%	11,0%
29.12.2014	bis	28.12.2015	-5,2%	-1,1%	-15,3%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-3,9%	6,9%	3,4%
26.12.2016	bis	25.12.2017	-12,2%	-6,7%	-1,9%
25.12.2017	bis	31.12.2018	16,8%	10,2%	-10,4%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-1,1%	-6,0%	16,0%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-31,9%	-24,6%	0,2%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-4,5%	-8,5%	-4,6%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003	bis	27.12.2004	23,3%	27,9%	13,5%	30,2%	29,6%	22,1%	26,8%	32,6%	22,8%	52,5%	38,8%
27.12.2004	bis	28.12.2009	3,2%	2,4%	0,3%	-0,3%	3,9%	7,4%	-4,9%	2,5%	0,9%	12,8%	3,8%
28.12.2009	bis	29.12.2014	18,0%	21,7%	14,9%	19,1%	18,2%	20,8%	19,1%	18,0%	15,1%	13,4%	22,1%
29.12.2014	bis	30.12.2019	15,0%	18,4%	14,1%	14,0%	15,9%	13,1%	10,9%	10,5%	3,0%	8,9%	14,3%
30.12.2019	bis	27.12.2021	37,9%	22,2%	21,1%	32,9%	23,3%	23,2%	23,4%	22,1%	37,3%	33,1%	37,9%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003	bis	27.12.2004	21,0%	16,5%	16,7%	19,1%	19,9%	20,7%	21,8%	29,1%	31,2%	33,8%	35,8%
27.12.2004	bis	28.12.2009	24,4%	20,1%	22,1%	22,7%	24,0%	26,7%	28,0%	31,1%	31,6%	34,6%	38,6%
28.12.2009	bis	29.12.2014	17,4%	14,9%	17,0%	16,5%	18,0%	18,4%	19,6%	20,4%	23,2%	24,3%	29,0%
29.12.2014	bis	30.12.2019	18,0%	14,5%	16,3%	15,5%	17,5%	17,9%	18,7%	18,7%	20,5%	22,3%	24,4%
30.12.2019	bis	27.12.2021	24,5%	23,9%	23,3%	24,8%	23,4%	24,0%	26,5%	28,3%	26,8%	26,7%	35,1%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003	bis	27.12.2004	15,1%	9,5%	9,4%	10,2%	13,0%	15,7%	16,1%	27,2%	32,0%	29,5%	35,5%
27.12.2004	bis	28.12.2009	52,6%	43,5%	37,4%	54,6%	59,1%	55,8%	65,2%	56,8%	60,3%	66,8%	74,6%
28.12.2009	bis	29.12.2014	15,7%	16,0%	21,1%	15,0%	22,1%	21,1%	23,2%	22,2%	32,0%	25,7%	40,6%
29.12.2014	bis	30.12.2019	22,9%	15,3%	20,4%	16,2%	15,9%	22,3%	27,3%	19,0%	35,0%	32,7%	21,9%
30.12.2019	bis	27.12.2021	27,2%	29,9%	32,0%	28,5%	29,0%	30,3%	31,6%	36,9%	22,2%	25,6%	39,3%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
06.01.2003	bis	27.12.2004	27,1%	21,9%	23,3%	17,8%	15,8%	21,0%	12,0%	12,0%	15,1%
27.12.2004	bis	28.12.2009	2,6%	6,3%	3,2%	21,5%	15,6%	24,4%	41,5%	24,8%	52,6%
28.12.2009	bis	29.12.2014	22,5%	18,6%	18,0%	15,5%	12,2%	17,4%	17,0%	13,0%	15,7%
29.12.2014	bis	30.12.2019	14,3%	12,1%	15,0%	15,8%	13,0%	18,0%	17,2%	14,0%	22,9%
30.12.2019	bis	27.12.2021	19,9%	17,6%	37,9%	21,9%	14,4%	24,5%	28,8%	18,3%	27,2%

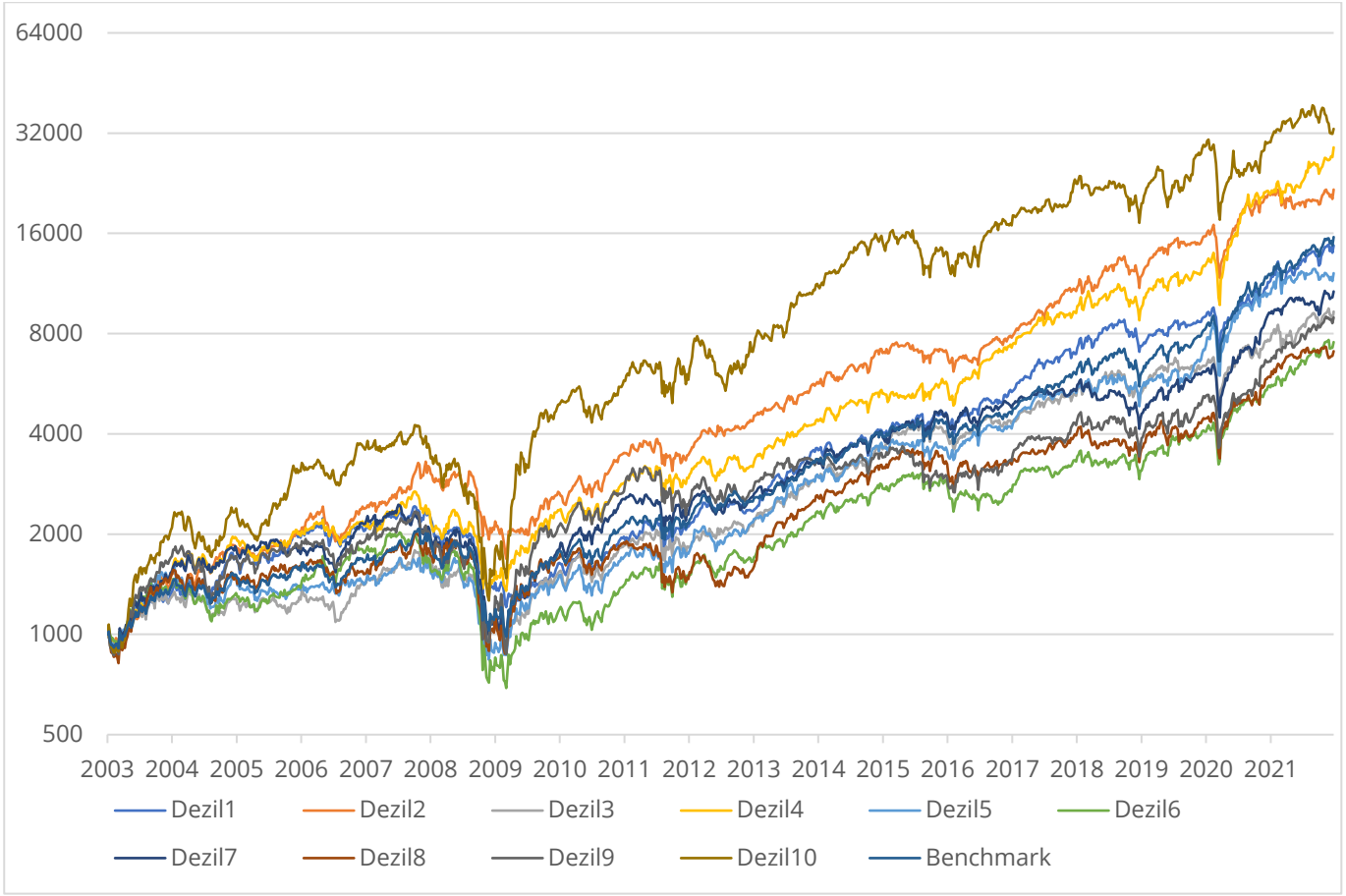
Technischer Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	06.01.2003	Region:	USA (Nasdaq100)
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	Nasdaq100
Durchschnittliche Anzahl Aktien	101	Scoring-Modell:	Technischer Score

Dezilanalyse

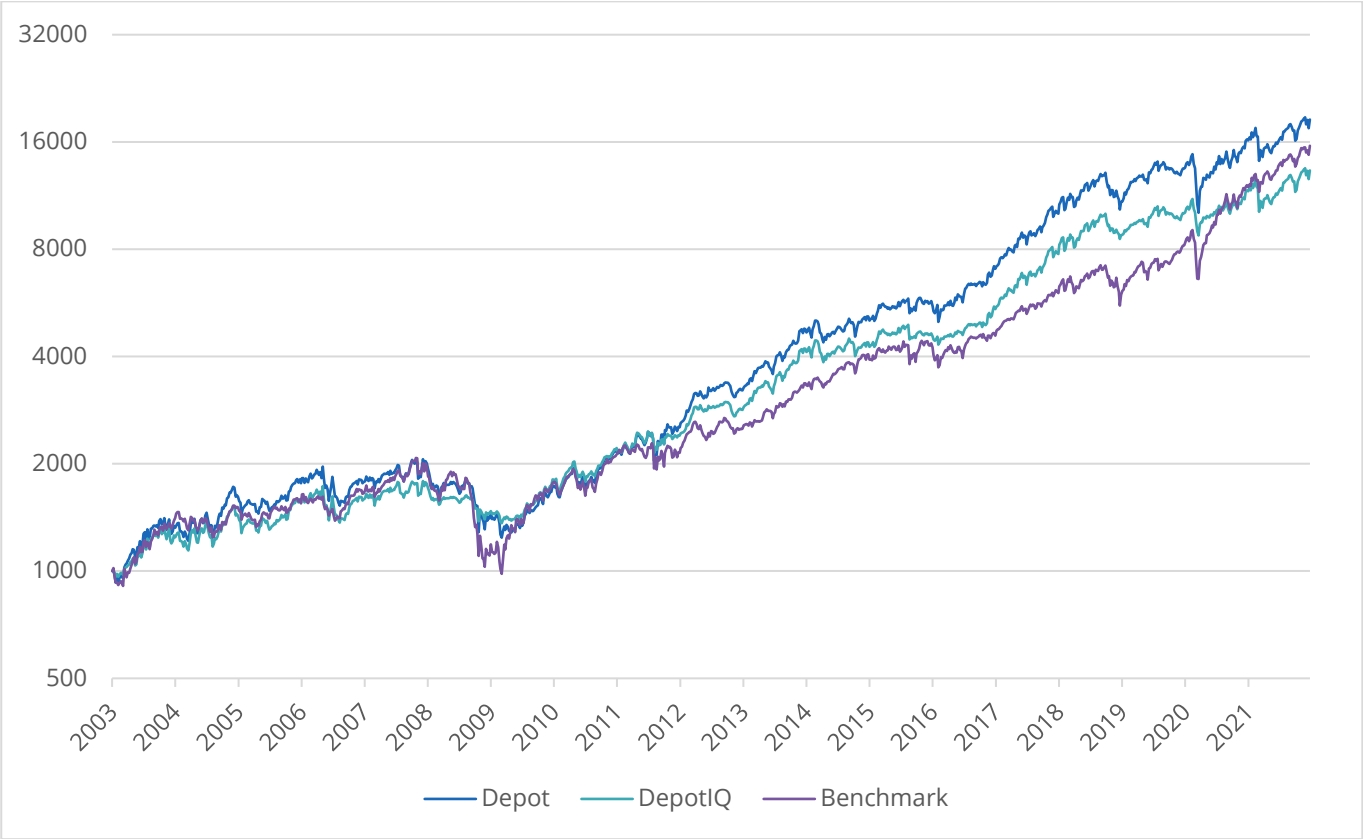
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	15,5%	15,2%	17,5%	12,4%	19,3%	14,0%	11,2%	13,3%	10,8%	12,2%	20,2%
Annualisierte Volatilität	20,7%	20,4%	20,4%	22,0%	22,1%	22,7%	22,6%	22,6%	24,2%	26,7%	30,5%
Maximaler Drawdown	52,6%	50,3%	48,9%	51,3%	51,4%	50,5%	65,9%	63,4%	57,1%	62,6%	70,3%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,749	0,742	0,860	0,566	0,874	0,617	0,495	0,587	0,448	0,457	0,660
Max 3 Jahre rollierend	164,9%	129,7%	142,0%	116,4%	209,9%	137,2%	147,8%	194,2%	158,4%	213,8%	411,6%
Min 3 Jahre rollierend	-36,9%	-43,3%	-23,9%	-30,6%	-36,5%	-40,7%	-53,6%	-50,0%	-47,1%	-52,3%	-58,7%
Max 5 Jahre rollierend	251,4%	218,9%	261,4%	264,4%	357,9%	259,8%	250,3%	303,2%	210,5%	287,8%	733,8%
Min 5 Jahre rollierend	-25,4%	-15,2%	21,2%	-28,7%	-16,5%	-43,7%	-48,0%	-44,8%	-38,5%	-49,8%	-36,0%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	55,3%	63,4%	37,9%	63,8%	40,0%	34,0%	43,8%	37,5%	38,7%	57,0%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	16,5%	14,6%	15,5%
Annualisierte Volatilität	21,3%	17,6%	20,7%
Maximaler Drawdown	39,7%	23,9%	52,6%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,777	0,825	0,749
Max 3 Jahre rollierend	149,0%	122,5%	164,9%
Min 3 Jahre rollierend	-34,7%	-19,9%	-36,9%
Max 5 Jahre rollierend	306,6%	225,8%	251,4%
Min 5 Jahre rollierend	-8,7%	4,2%	-25,4%
Anteil Outperformance 1 Jahr	57,9%	51,5%	---

Anzahl Aktien im Depot	8	
Verkaufskriterium 1	Technisch	70%
Verkaufskriterium 2	Technisch	70%
Depotumschlagsfaktor	1,76	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
06.01.2003	bis	29.12.2003	-4,6%	1,8%	49,1%
29.12.2003	bis	27.12.2004	12,8%	17,2%	-1,8%
27.12.2004	bis	26.12.2005	5,8%	8,8%	15,4%
26.12.2005	bis	25.12.2006	-6,4%	6,0%	5,7%
25.12.2006	bis	31.12.2007	-5,4%	3,5%	-16,4%
31.12.2007	bis	29.12.2008	13,7%	6,1%	-7,8%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-36,5%	-35,6%	96,9%
28.12.2009	bis	27.12.2010	5,9%	5,8%	1,9%
27.12.2010	bis	26.12.2011	14,8%	1,1%	-2,6%
26.12.2011	bis	31.12.2012	10,3%	2,5%	-3,0%
31.12.2012	bis	30.12.2013	14,2%	8,8%	8,0%
30.12.2013	bis	29.12.2014	-12,2%	-1,3%	1,1%
29.12.2014	bis	28.12.2015	3,1%	-1,2%	-19,5%
28.12.2015	bis	26.12.2016	18,5%	6,9%	9,4%
26.12.2016	bis	25.12.2017	10,4%	1,9%	1,4%
25.12.2017	bis	31.12.2018	9,4%	9,2%	-16,4%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-13,6%	-9,9%	12,6%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-26,5%	-16,3%	-31,5%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-15,5%	-13,4%	-6,5%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003 bis 27.12.2004	23,3%	30,9%	36,2%	13,3%	40,4%	21,8%	15,1%	36,1%	22,0%	31,3%	53,7%
27.12.2004 bis 28.12.2009	3,2%	-0,9%	7,7%	3,6%	3,8%	-0,1%	-2,4%	-0,5%	2,6%	4,1%	15,8%
28.12.2009 bis 29.12.2014	18,0%	20,2%	21,7%	19,4%	18,0%	20,6%	19,2%	17,6%	13,8%	10,8%	26,2%
29.12.2014 bis 30.12.2019	15,0%	16,8%	16,8%	11,5%	18,5%	13,6%	7,5%	8,6%	6,6%	7,9%	13,1%
30.12.2019 bis 27.12.2021	37,9%	28,1%	17,5%	20,7%	50,9%	30,4%	36,4%	32,1%	26,3%	31,9%	6,4%

Annualisierte Volatilität	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003 bis 27.12.2004	21,0%	22,4%	21,2%	22,0%	21,4%	24,0%	22,6%	23,8%	26,1%	28,9%	31,5%
27.12.2004 bis 28.12.2009	24,4%	22,4%	23,3%	25,0%	24,6%	25,7%	29,3%	28,1%	31,0%	34,7%	38,7%
28.12.2009 bis 29.12.2014	17,4%	17,8%	17,9%	19,7%	19,3%	20,3%	19,2%	19,0%	19,6%	22,0%	26,2%
29.12.2014 bis 30.12.2019	18,0%	16,6%	17,1%	18,0%	18,7%	18,4%	17,5%	17,9%	19,3%	21,3%	24,7%
30.12.2019 bis 27.12.2021	24,5%	27,1%	25,1%	28,0%	29,5%	28,5%	22,9%	24,7%	24,7%	24,6%	30,1%

Maximaler Drawdown	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003 bis 27.12.2004	15,1%	11,5%	12,6%	16,7%	12,2%	25,0%	25,4%	11,7%	20,4%	33,0%	26,8%
27.12.2004 bis 28.12.2009	52,6%	50,3%	48,9%	51,3%	51,4%	50,5%	65,9%	63,4%	57,1%	62,6%	70,3%
28.12.2009 bis 29.12.2014	15,7%	19,3%	20,0%	19,3%	18,7%	20,3%	21,0%	21,0%	29,8%	28,3%	31,5%
29.12.2014 bis 30.12.2019	22,9%	19,8%	19,7%	21,0%	22,1%	19,7%	23,5%	28,9%	25,3%	27,4%	27,8%
30.12.2019 bis 27.12.2021	27,2%	26,9%	30,8%	30,1%	30,3%	30,6%	25,1%	30,9%	27,1%	30,8%	42,5%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum	Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
06.01.2003 bis 27.12.2004	28,2%	20,5%	23,3%	23,9%	22,0%	21,0%	14,5%	14,5%	15,1%
27.12.2004 bis 28.12.2009	1,2%	4,5%	3,2%	22,4%	17,6%	24,4%	39,7%	23,9%	52,6%
28.12.2009 bis 29.12.2014	24,4%	19,3%	18,0%	18,4%	15,1%	17,4%	17,2%	13,2%	15,7%
29.12.2014 bis 30.12.2019	21,0%	18,1%	15,0%	18,3%	15,7%	18,0%	21,0%	15,0%	22,9%
30.12.2019 bis 27.12.2021	17,2%	14,8%	37,9%	28,5%	22,9%	24,5%	31,5%	21,1%	27,2%

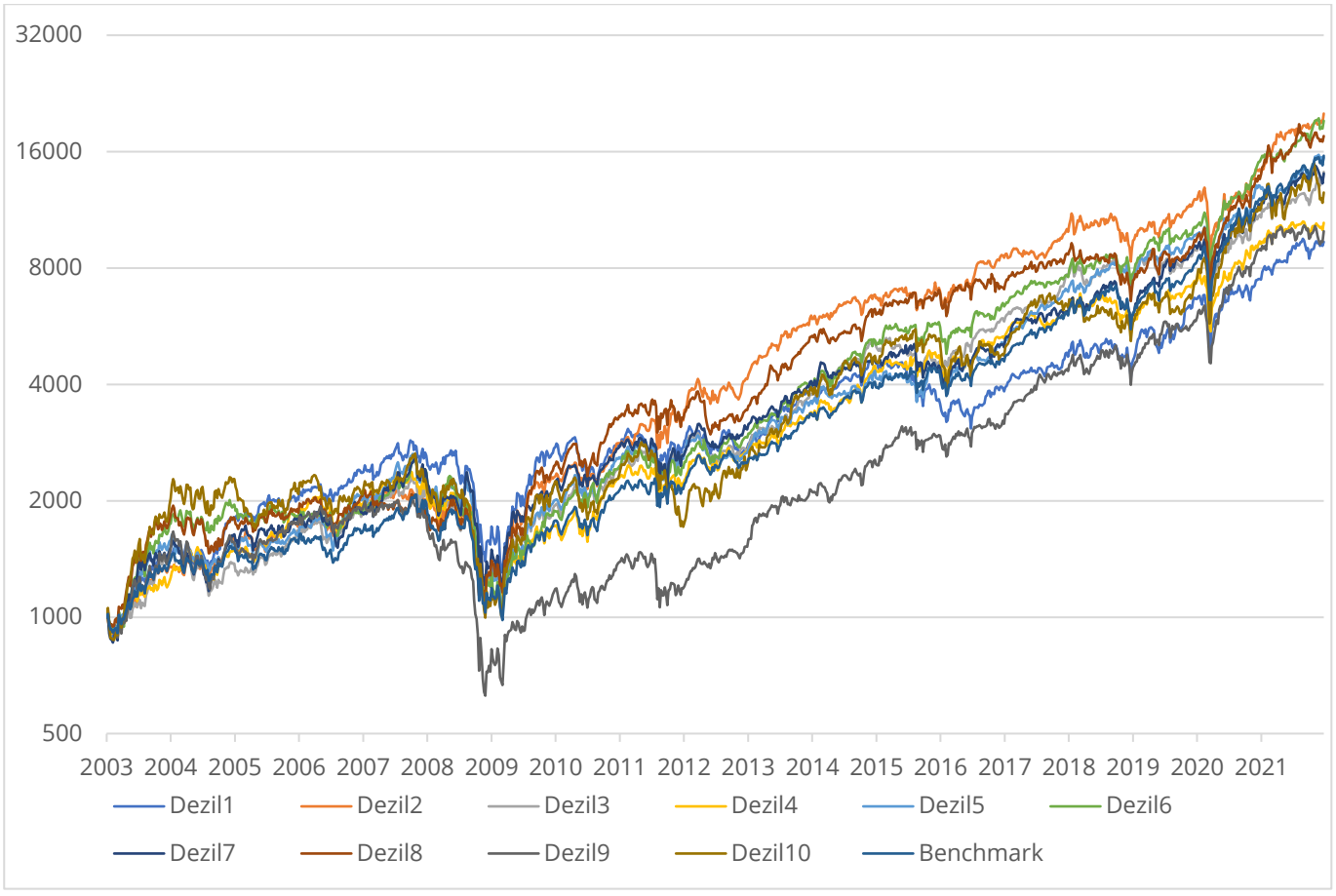
Value-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	06.01.2003	Region:	USA (Nasdaq100)
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	Nasdaq100
Durchschnittliche Anzahl Aktien	99	Scoring-Modell:	Value-Score

Dezilanalyse

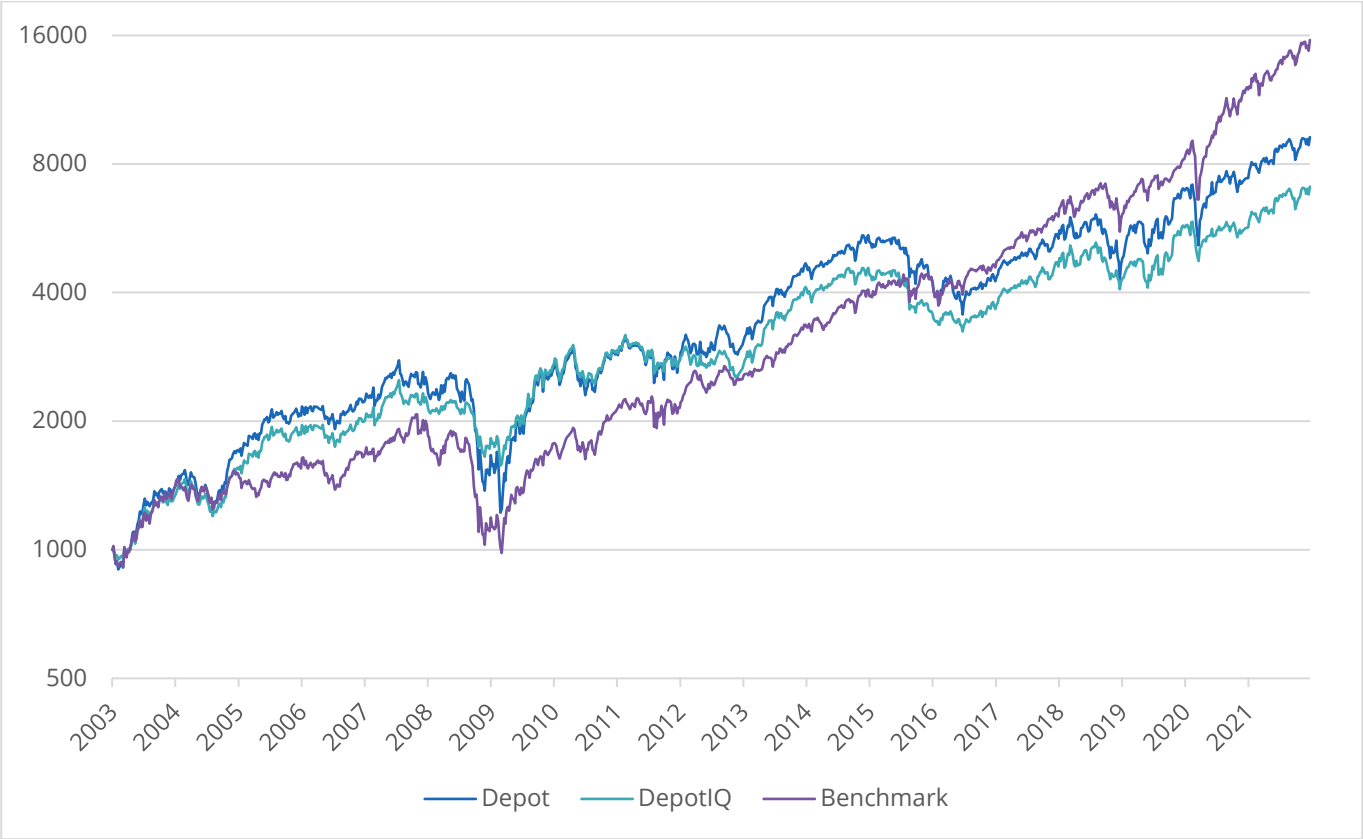
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	15,5%	12,5%	17,1%	15,0%	13,1%	15,5%	16,8%	14,9%	16,2%	12,8%	14,2%
Annualisierte Volatilität	20,7%	22,1%	23,4%	21,3%	21,3%	21,6%	22,7%	23,4%	23,5%	24,6%	28,1%
Maximaler Drawdown	52,6%	54,4%	47,8%	51,2%	53,1%	60,1%	59,0%	55,1%	48,4%	68,8%	62,4%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,749	0,563	0,729	0,703	0,616	0,717	0,741	0,635	0,692	0,522	0,505
Max 3 Jahre rollierend	164,9%	138,6%	245,0%	153,8%	127,7%	171,8%	159,6%	150,5%	220,3%	139,8%	176,6%
Min 3 Jahre rollierend	-36,9%	-38,7%	-35,3%	-33,2%	-43,8%	-38,0%	-42,8%	-33,2%	-42,1%	-64,5%	-55,1%
Max 5 Jahre rollierend	251,4%	197,1%	428,3%	261,7%	223,2%	268,6%	313,5%	284,1%	367,0%	262,1%	320,8%
Min 5 Jahre rollierend	-25,4%	-11,9%	-14,3%	-15,9%	-15,2%	-24,6%	-42,6%	-15,7%	-36,3%	-56,1%	-52,1%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	41,3%	52,8%	53,2%	42,1%	51,5%	55,3%	44,7%	47,2%	44,3%	45,1%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	12,4%	10,8%	15,5%
Annualisierte Volatilität	23,2%	17,9%	20,7%
Maximaler Drawdown	56,0%	37,0%	52,6%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,534	0,606	0,749
Max 3 Jahre rollierend	146,0%	103,4%	164,9%
Min 3 Jahre rollierend	-42,2%	-17,6%	-36,9%
Max 5 Jahre rollierend	273,5%	155,7%	251,4%
Min 5 Jahre rollierend	-17,8%	-4,7%	-25,4%
Anteil Outperformance 1 Jahr	36,2%	32,3%	---

Anzahl Aktien im Depot	8	
Verkaufskriterium 1	Value	90%
Verkaufskriterium 2	Value	90%
Depotumschlagsfaktor	0,90	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
06.01.2003	bis	29.12.2003	0,5%	1,1%	31,3%
29.12.2003	bis	27.12.2004	13,3%	13,3%	3,2%
27.12.2004	bis	26.12.2005	17,5%	5,0%	-1,3%
26.12.2005	bis	25.12.2006	2,5%	9,3%	-1,4%
25.12.2006	bis	31.12.2007	-8,1%	-11,5%	-18,9%
31.12.2007	bis	29.12.2008	4,4%	4,7%	-12,0%
29.12.2008	bis	28.12.2009	15,6%	20,0%	23,2%
28.12.2009	bis	27.12.2010	-9,6%	-6,8%	-7,6%
27.12.2010	bis	26.12.2011	-6,5%	4,7%	-20,5%
26.12.2011	bis	31.12.2012	-6,8%	-3,2%	16,8%
31.12.2012	bis	30.12.2013	21,1%	11,2%	16,1%
30.12.2013	bis	29.12.2014	-4,3%	-4,8%	-0,6%
29.12.2014	bis	28.12.2015	-27,8%	-16,2%	6,3%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-6,9%	7,1%	-6,8%
26.12.2016	bis	25.12.2017	-4,3%	-10,6%	3,9%
25.12.2017	bis	31.12.2018	-12,7%	-7,1%	-5,9%
31.12.2018	bis	30.12.2019	11,0%	3,6%	-3,7%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-40,6%	-31,0%	6,7%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-4,2%	2,9%	-17,9%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003	bis	27.12.2004	23,3%	34,9%	27,5%	17,6%	22,3%	25,0%	40,1%	27,9%	35,0%	25,4%	51,5%
27.12.2004	bis	28.12.2009	3,2%	8,6%	7,3%	7,0%	2,9%	5,2%	-0,6%	6,3%	6,3%	-5,7%	-0,7%
28.12.2009	bis	29.12.2014	18,0%	11,4%	24,2%	21,7%	21,0%	16,6%	22,4%	16,1%	20,5%	16,9%	16,6%
29.12.2014	bis	30.12.2019	15,0%	7,1%	11,9%	11,3%	10,5%	17,5%	14,3%	14,3%	8,3%	17,9%	8,9%
30.12.2019	bis	27.12.2021	37,9%	18,6%	29,3%	26,4%	19,0%	26,0%	37,5%	24,1%	36,9%	30,7%	31,1%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003	bis	27.12.2004	21,0%	18,8%	21,1%	20,6%	21,4%	23,2%	27,1%	26,2%	26,1%	30,3%	32,9%
27.12.2004	bis	28.12.2009	24,4%	27,0%	29,3%	26,2%	25,0%	26,5%	27,1%	29,4%	26,4%	29,4%	31,3%
28.12.2009	bis	29.12.2014	17,4%	19,2%	19,3%	18,8%	19,4%	18,7%	19,9%	19,5%	20,9%	21,1%	23,9%
29.12.2014	bis	30.12.2019	18,0%	20,1%	18,2%	16,6%	18,0%	16,2%	17,4%	18,2%	19,3%	19,4%	22,6%
30.12.2019	bis	27.12.2021	24,5%	23,3%	29,6%	24,4%	23,4%	24,8%	23,7%	24,7%	28,2%	24,8%	35,8%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003	bis	27.12.2004	15,1%	14,0%	11,6%	21,3%	17,6%	19,8%	12,4%	25,8%	24,7%	29,1%	19,3%
27.12.2004	bis	28.12.2009	52,6%	54,4%	47,8%	51,2%	53,1%	60,1%	59,0%	55,1%	48,4%	68,8%	62,4%
28.12.2009	bis	29.12.2014	15,7%	23,8%	16,5%	22,2%	18,8%	24,8%	20,5%	25,2%	22,7%	28,0%	39,5%
29.12.2014	bis	30.12.2019	22,9%	34,6%	24,8%	19,1%	21,4%	17,0%	17,3%	23,6%	29,2%	20,9%	30,4%
30.12.2019	bis	27.12.2021	27,2%	27,9%	38,0%	32,3%	29,4%	30,1%	29,5%	26,9%	31,7%	29,1%	32,4%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
06.01.2003	bis	27.12.2004	30,9%	24,8%	23,3%	18,9%	16,2%	21,0%	18,1%	18,1%	15,1%
27.12.2004	bis	28.12.2009	9,0%	11,6%	3,2%	28,2%	19,9%	24,4%	56,0%	37,0%	52,6%
28.12.2009	bis	29.12.2014	15,7%	11,2%	18,0%	20,4%	16,3%	17,4%	21,9%	20,6%	15,7%
29.12.2014	bis	30.12.2019	4,9%	4,4%	15,0%	21,8%	18,0%	18,0%	34,8%	29,1%	22,9%
30.12.2019	bis	27.12.2021	15,5%	11,6%	37,9%	23,3%	17,6%	24,5%	27,9%	19,1%	27,2%

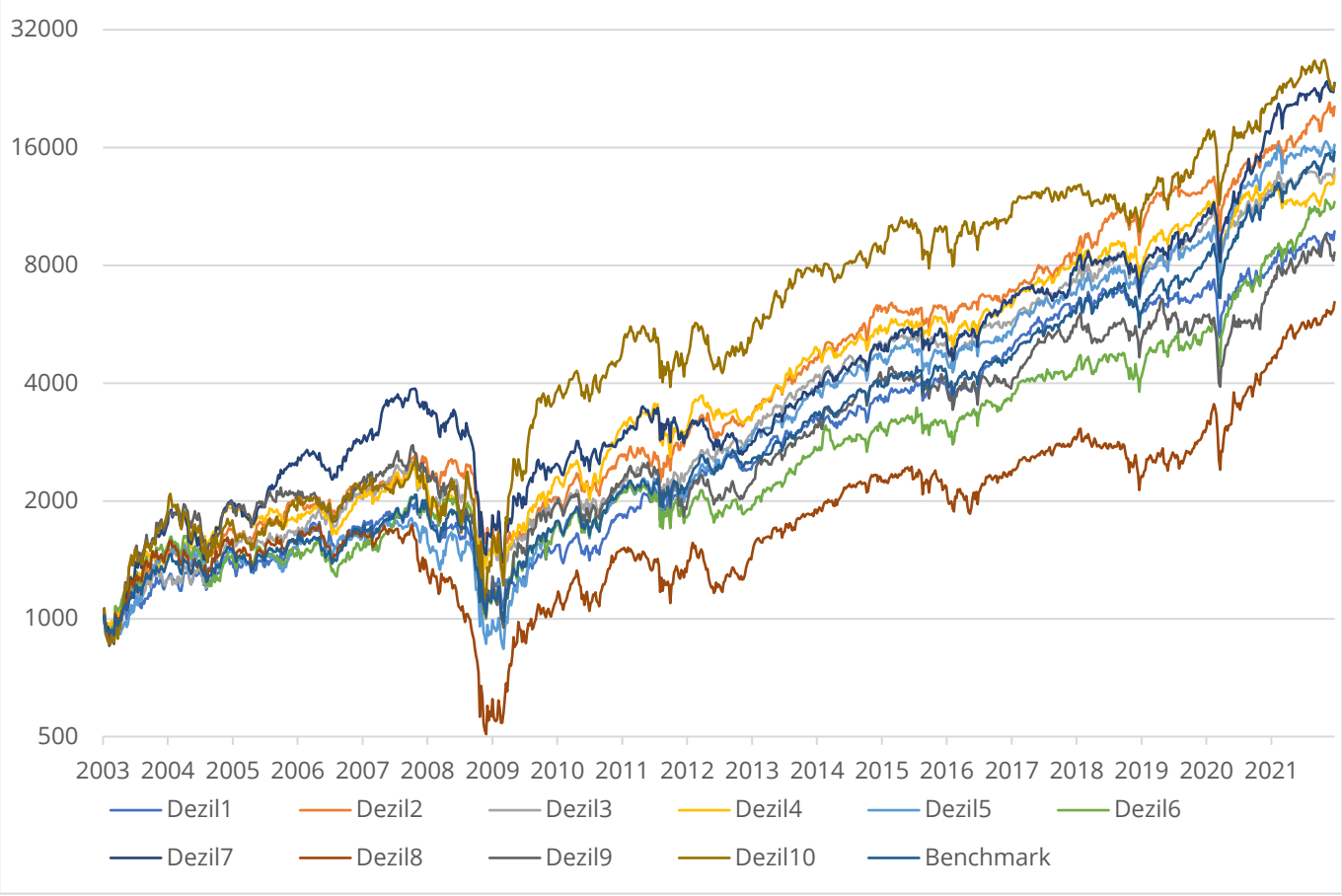
Kombi-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	06.01.2003	Region:	USA (Nasdaq100)
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	Nasdaq100
Durchschnittliche Anzahl Aktien	99	Scoring-Modell:	Kombi-Score

Dezilanalyse

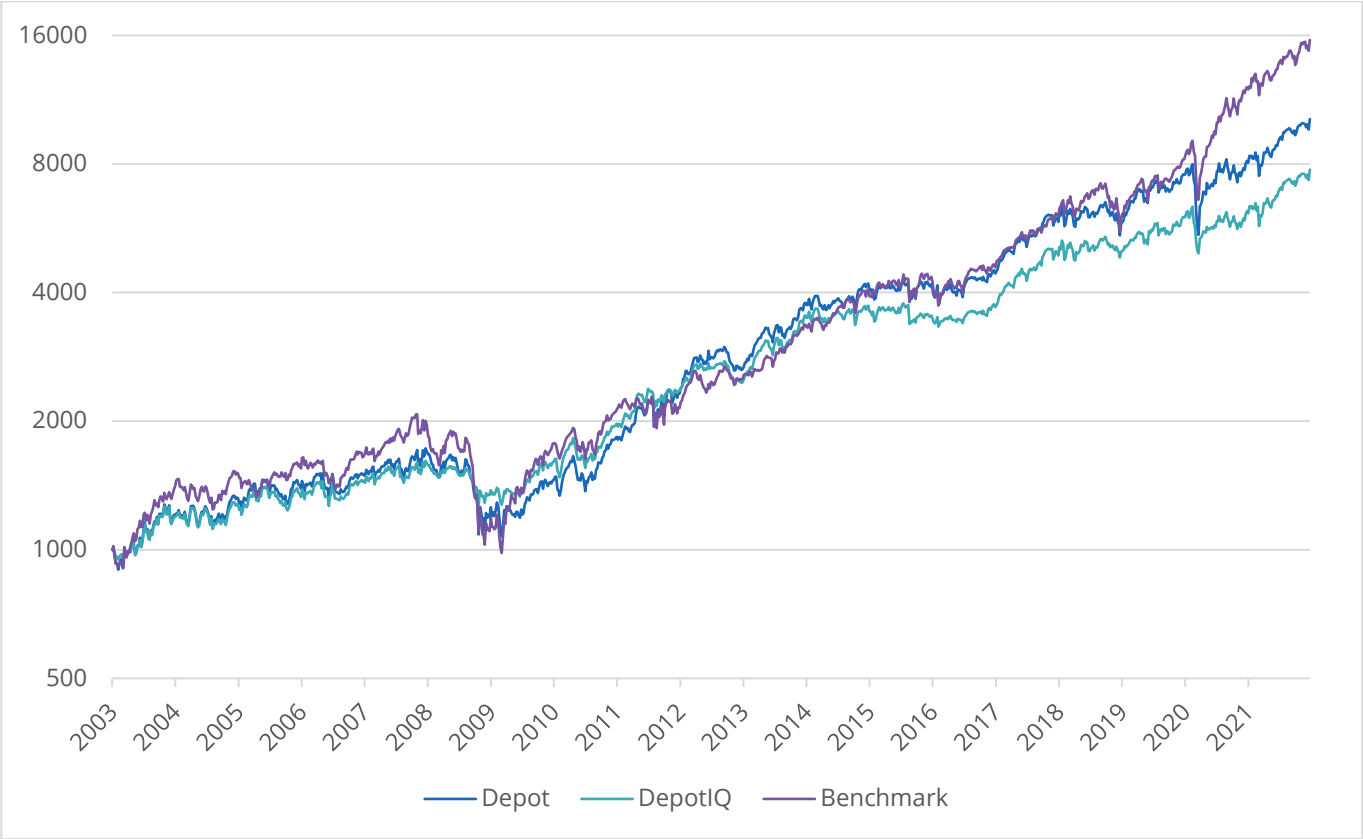
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	15,5%	12,7%	17,1%	14,9%	14,7%	15,8%	13,7%	18,0%	10,3%	12,0%	18,0%
Annualisierte Volatilität	20,7%	20,1%	20,2%	20,4%	21,1%	22,2%	23,9%	24,5%	25,1%	24,7%	30,3%
Maximaler Drawdown	52,6%	47,7%	48,5%	51,4%	48,9%	53,7%	53,5%	64,0%	71,0%	65,8%	56,7%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,749	0,634	0,848	0,733	0,697	0,710	0,575	0,735	0,410	0,485	0,594
Max 3 Jahre rollierend	164,9%	112,1%	138,1%	124,8%	185,6%	178,5%	195,8%	232,0%	188,8%	139,1%	364,8%
Min 3 Jahre rollierend	-36,9%	-37,1%	-28,7%	-30,5%	-32,1%	-49,0%	-35,5%	-47,4%	-68,1%	-52,6%	-43,3%
Max 5 Jahre rollierend	251,4%	208,1%	273,3%	257,5%	285,7%	374,9%	233,9%	339,2%	267,0%	262,8%	608,1%
Min 5 Jahre rollierend	-25,4%	-15,9%	-2,9%	-1,4%	-11,2%	-42,5%	-34,3%	-31,4%	-65,1%	-48,1%	-36,2%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	46,0%	62,6%	45,1%	48,5%	57,0%	40,9%	58,7%	33,2%	41,3%	49,8%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	13,0%	11,4%	15,5%
Annualisierte Volatilität	20,0%	15,9%	20,7%
Maximaler Drawdown	37,9%	22,3%	52,6%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,647	0,712	0,749
Max 3 Jahre rollierend	146,2%	105,2%	164,9%
Min 3 Jahre rollierend	-25,0%	-7,1%	-36,9%
Max 5 Jahre rollierend	265,6%	187,3%	251,4%
Min 5 Jahre rollierend	-14,9%	0,8%	-25,4%
Anteil Outperformance 1 Jahr	42,1%	35,3%	---

Anzahl Aktien im Depot	8	
Verkaufskriterium 1	Kombi	70%
Verkaufskriterium 2	Kombi	70%
Depotumschlagsfaktor	1,36	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
06.01.2003	bis	29.12.2003	-17,9%	-3,0%	41,2%
29.12.2003	bis	27.12.2004	0,5%	4,6%	-5,0%
27.12.2004	bis	26.12.2005	1,9%	12,1%	3,1%
26.12.2005	bis	25.12.2006	2,3%	2,3%	3,9%
25.12.2006	bis	31.12.2007	-5,9%	-1,8%	-16,0%
31.12.2007	bis	29.12.2008	14,2%	5,1%	-0,2%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-38,8%	-31,1%	65,1%
28.12.2009	bis	27.12.2010	6,6%	5,2%	-1,0%
27.12.2010	bis	26.12.2011	25,1%	8,6%	-10,6%
26.12.2011	bis	31.12.2012	-2,6%	-2,2%	-1,4%
31.12.2012	bis	30.12.2013	9,1%	6,3%	14,1%
30.12.2013	bis	29.12.2014	-9,8%	3,6%	3,3%
29.12.2014	bis	28.12.2015	-7,6%	-3,3%	-2,3%
28.12.2015	bis	26.12.2016	0,8%	9,5%	-6,7%
26.12.2016	bis	25.12.2017	1,6%	-5,7%	0,5%
25.12.2017	bis	31.12.2018	-0,8%	6,7%	-13,8%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-7,1%	-14,0%	3,9%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-39,8%	-27,9%	-26,2%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-3,8%	-3,6%	-11,4%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003 bis 27.12.2004	23,3%	18,3%	30,7%	26,3%	39,0%	23,0%	20,2%	42,1%	25,6%	41,5%	32,9%
27.12.2004 bis 28.12.2009	3,2%	1,9%	3,8%	4,9%	3,6%	2,9%	3,6%	4,4%	-6,8%	-0,3%	16,5%
28.12.2009 bis 29.12.2014	18,0%	19,4%	25,1%	20,3%	19,5%	22,2%	13,0%	15,2%	15,8%	16,7%	18,8%
29.12.2014 bis 30.12.2019	15,0%	13,4%	14,9%	14,7%	14,5%	14,5%	11,2%	16,0%	5,4%	6,8%	13,2%
30.12.2019 bis 27.12.2021	37,9%	18,0%	26,9%	17,9%	10,6%	31,8%	46,7%	48,3%	46,8%	20,6%	18,0%

Annualisierte Volatilität	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003 bis 27.12.2004	21,0%	19,5%	19,4%	21,5%	21,6%	24,0%	24,9%	27,2%	26,4%	29,4%	33,2%
27.12.2004 bis 28.12.2009	24,4%	23,5%	23,4%	22,9%	23,6%	26,7%	29,1%	29,6%	31,3%	29,2%	39,5%
28.12.2009 bis 29.12.2014	17,4%	17,1%	18,4%	18,1%	19,7%	18,7%	20,5%	20,3%	21,5%	20,4%	24,8%
29.12.2014 bis 30.12.2019	18,0%	16,3%	16,9%	16,4%	17,3%	17,6%	19,8%	19,9%	19,9%	20,3%	23,8%
30.12.2019 bis 27.12.2021	24,5%	26,1%	24,0%	26,2%	25,5%	26,3%	25,8%	27,6%	26,1%	27,3%	27,9%

Maximaler Drawdown	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
06.01.2003 bis 27.12.2004	15,1%	12,0%	9,2%	12,4%	12,8%	17,1%	25,6%	26,5%	19,3%	26,5%	33,1%
27.12.2004 bis 28.12.2009	52,6%	47,7%	48,5%	51,4%	48,9%	53,7%	53,5%	64,0%	71,0%	65,8%	56,7%
28.12.2009 bis 29.12.2014	15,7%	17,7%	19,2%	19,4%	26,9%	17,6%	23,0%	24,9%	27,8%	27,2%	30,1%
29.12.2014 bis 30.12.2019	22,9%	17,5%	19,4%	19,8%	20,4%	17,9%	20,4%	23,3%	30,3%	23,0%	26,1%
30.12.2019 bis 27.12.2021	27,2%	29,1%	27,4%	33,6%	35,2%	26,9%	23,1%	29,5%	32,1%	34,7%	35,9%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum	Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
06.01.2003 bis 27.12.2004	15,2%	13,2%	23,3%	20,8%	18,7%	21,0%	11,4%	11,4%	15,1%
27.12.2004 bis 28.12.2009	1,9%	4,6%	3,2%	22,0%	16,1%	24,4%	37,8%	21,2%	52,6%
28.12.2009 bis 29.12.2014	23,6%	18,4%	18,0%	17,7%	14,3%	17,4%	17,3%	14,8%	15,7%
29.12.2014 bis 30.12.2019	12,4%	10,0%	15,0%	17,1%	14,6%	18,0%	16,3%	11,8%	22,9%
30.12.2019 bis 27.12.2021	16,1%	13,6%	37,9%	25,9%	19,5%	24,5%	31,7%	22,3%	27,2%

USA – S&P 900

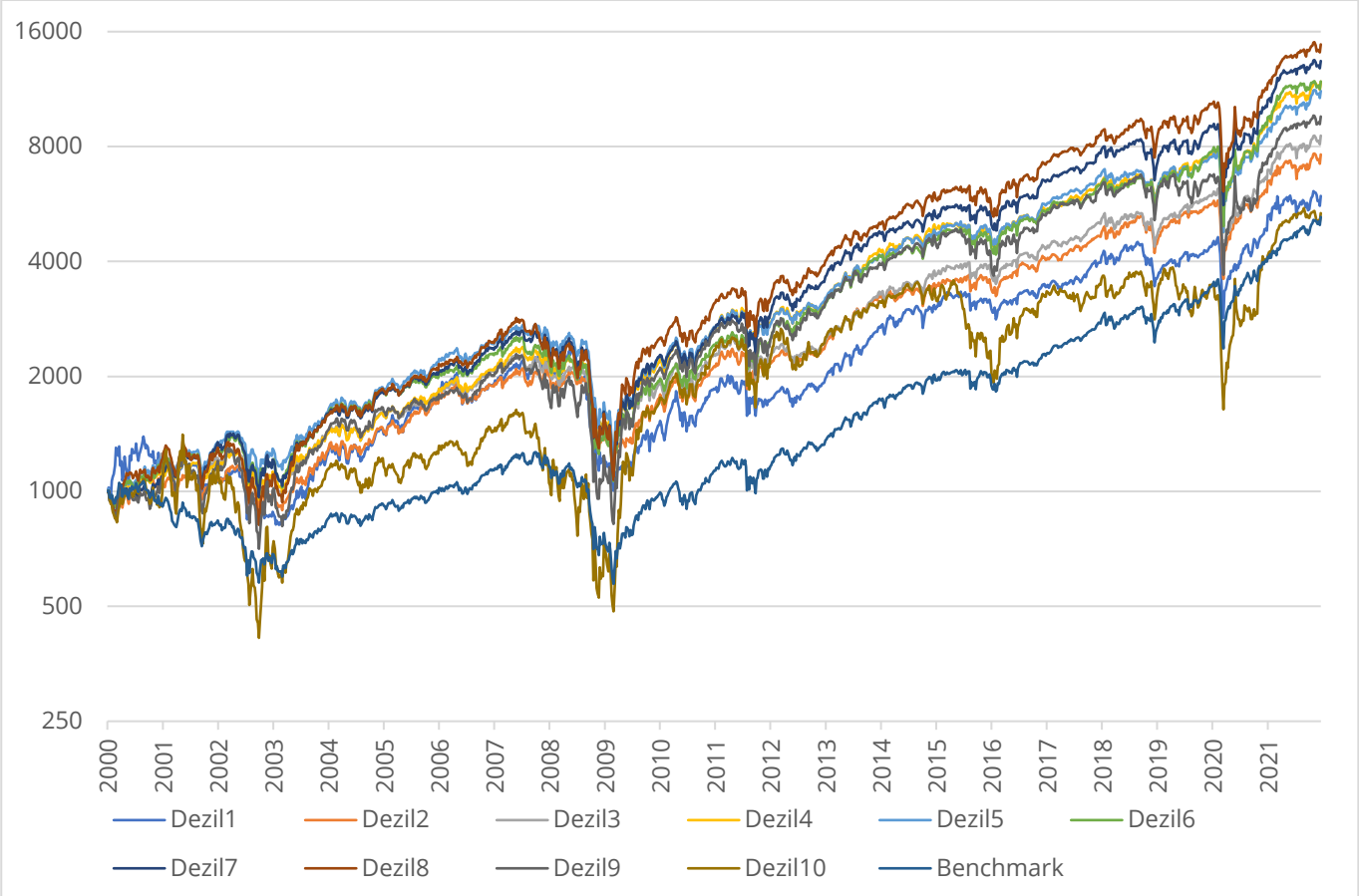
Trend-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	10.01.2000	Region:	USA (S&P 900)
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	S&P 900
Durchschnittliche Anzahl Aktien	888	Scoring-Modell:	Trend-Score

Dezilanalyse

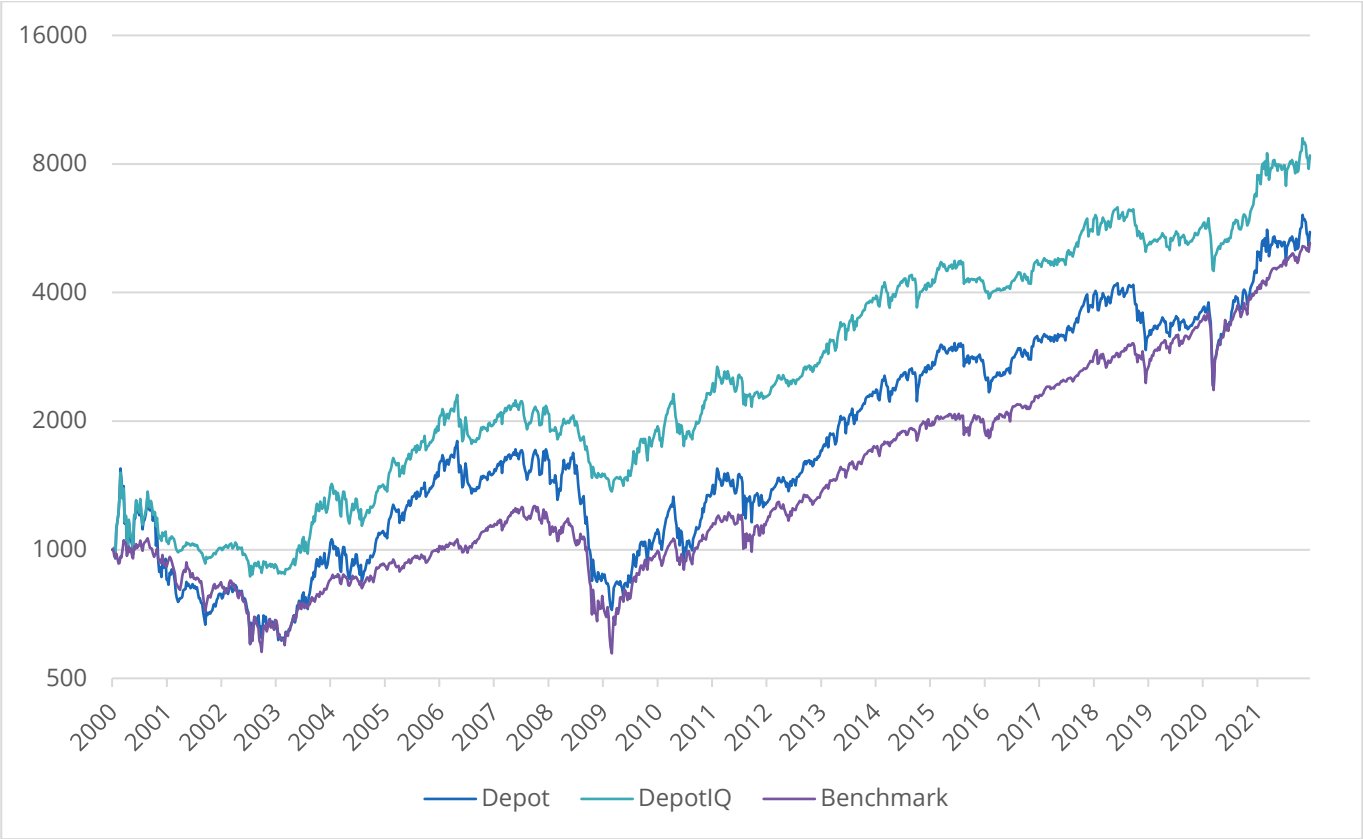
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	7,8%	8,4%	9,7%	10,2%	11,9%	11,6%	11,9%	12,5%	13,0%	10,8%	7,9%
Annualisierte Volatilität	18,8%	22,7%	19,3%	19,4%	19,4%	19,8%	20,2%	21,5%	23,5%	26,2%	35,1%
Maximaler Drawdown	54,9%	57,6%	46,2%	50,7%	49,6%	55,0%	58,1%	59,3%	62,4%	64,1%	70,6%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,415	0,371	0,500	0,528	0,610	0,585	0,586	0,582	0,553	0,413	0,226
Max 3 Jahre rollierend	117,6%	134,7%	101,8%	109,1%	143,8%	136,2%	154,4%	197,3%	228,1%	233,7%	415,5%
Min 3 Jahre rollierend	-44,0%	-46,8%	-37,1%	-39,5%	-36,8%	-45,6%	-48,1%	-49,0%	-50,6%	-54,6%	-63,5%
Max 5 Jahre rollierend	208,1%	181,8%	190,8%	198,3%	263,4%	243,4%	288,9%	345,5%	382,6%	391,6%	574,6%
Min 5 Jahre rollierend	-32,0%	-21,2%	-11,0%	-19,6%	-14,8%	-25,5%	-34,5%	-32,4%	-34,3%	-46,1%	-58,0%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	50,7%	54,4%	59,5%	71,2%	66,1%	69,3%	71,5%	73,4%	58,8%	42,7%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	8,1%	10,1%	7,8%
Annualisierte Volatilität	27,9%	22,8%	18,8%
Maximaler Drawdown	61,1%	42,8%	54,9%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,290	0,443	0,415
Max 3 Jahre rollierend	166,3%	141,9%	117,6%
Min 3 Jahre rollierend	-59,9%	-41,5%	-44,0%
Max 5 Jahre rollierend	244,4%	202,5%	208,1%
Min 5 Jahre rollierend	-29,4%	-4,3%	-32,0%
Anteil Outperformance 1 Jahr	52,9%	56,9%	---

Anzahl Aktien im Depot	20	
Verkaufskriterium 1	Trend	70%
Verkaufskriterium 2	Trend	70%
Depotumschlagsfaktor	1,80	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
10.01.2000	bis	25.12.2000	-1,0%	21,7%	4,7%
25.12.2000	bis	31.12.2001	-3,2%	6,0%	26,4%
31.12.2001	bis	30.12.2002	4,2%	5,3%	-9,9%
30.12.2002	bis	29.12.2003	18,3%	8,6%	38,5%
29.12.2003	bis	27.12.2004	4,2%	6,4%	1,2%
27.12.2004	bis	26.12.2005	29,2%	11,7%	-2,8%
26.12.2005	bis	25.12.2006	-14,5%	-5,3%	0,2%
25.12.2006	bis	31.12.2007	6,8%	7,3%	-18,0%
31.12.2007	bis	29.12.2008	-10,6%	-0,5%	-6,8%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-4,3%	-7,9%	103,6%
28.12.2009	bis	27.12.2010	6,7%	7,5%	16,1%
27.12.2010	bis	26.12.2011	-5,4%	-3,9%	-8,9%
26.12.2011	bis	31.12.2012	13,2%	-5,6%	4,1%
31.12.2012	bis	30.12.2013	8,8%	7,2%	-2,3%
30.12.2013	bis	29.12.2014	0,3%	-4,7%	-2,4%
29.12.2014	bis	28.12.2015	2,6%	2,6%	-20,5%
28.12.2015	bis	26.12.2016	0,9%	-1,1%	18,5%
26.12.2016	bis	25.12.2017	-3,0%	-6,8%	-8,0%
25.12.2017	bis	31.12.2018	-11,3%	-1,8%	-7,7%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-15,0%	-6,8%	-12,1%
30.12.2019	bis	28.12.2020	7,3%	-7,3%	-4,7%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-6,7%	-6,9%	2,0%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
10.01.2000 bis 27.12.2004	-1,5%	7,9%	8,1%	10,1%	10,0%	13,5%	13,1%	12,9%	13,2%	10,7%	4,0%
27.12.2004 bis 28.12.2009	1,0%	0,4%	3,4%	3,4%	6,2%	3,7%	1,0%	4,2%	6,1%	4,5%	6,7%
28.12.2009 bis 29.12.2014	15,6%	15,6%	14,9%	14,7%	18,1%	16,5%	19,1%	19,3%	19,3%	17,7%	15,0%
29.12.2014 bis 30.12.2019	11,1%	7,2%	9,9%	9,5%	8,8%	9,1%	10,6%	10,7%	11,2%	7,4%	0,3%
30.12.2019 bis 27.12.2021	23,6%	16,6%	16,5%	19,7%	24,5%	22,0%	23,8%	21,6%	19,7%	19,5%	24,7%

Annualisierte Volatilität	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
10.01.2000 bis 27.12.2004	19,2%	26,2%	19,2%	17,4%	16,8%	17,8%	17,9%	19,3%	22,6%	26,3%	39,3%
27.12.2004 bis 28.12.2009	21,8%	24,3%	20,8%	22,3%	22,8%	24,1%	25,1%	26,7%	29,7%	32,4%	43,1%
28.12.2009 bis 29.12.2014	16,7%	21,0%	19,3%	19,0%	18,9%	18,2%	18,0%	18,8%	19,5%	20,6%	24,6%
29.12.2014 bis 30.12.2019	14,2%	14,4%	13,6%	13,6%	13,5%	13,9%	14,4%	15,7%	16,6%	19,1%	26,0%
30.12.2019 bis 27.12.2021	24,2%	29,7%	26,9%	27,7%	28,6%	27,7%	28,5%	29,6%	31,4%	35,1%	43,2%

Maximaler Drawdown	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
10.01.2000 bis 27.12.2004	45,7%	41,5%	23,7%	25,8%	25,0%	25,6%	27,8%	32,1%	39,6%	45,5%	70,6%
27.12.2004 bis 28.12.2009	54,9%	57,6%	46,2%	50,7%	49,6%	55,0%	58,1%	59,3%	62,4%	64,1%	70,3%
28.12.2009 bis 29.12.2014	19,2%	21,7%	21,5%	23,1%	22,4%	22,1%	22,5%	22,1%	25,3%	28,1%	34,5%
29.12.2014 bis 30.12.2019	19,4%	23,5%	20,4%	18,8%	17,0%	20,6%	17,7%	21,9%	21,0%	24,5%	46,2%
30.12.2019 bis 27.12.2021	34,2%	38,5%	37,8%	39,3%	39,0%	38,4%	38,1%	38,8%	41,8%	45,4%	53,0%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum	Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
10.01.2000 bis 27.12.2004	2,1%	7,3%	-1,5%	35,5%	28,9%	19,2%	61,1%	42,8%	45,7%
27.12.2004 bis 28.12.2009	-0,2%	6,1%	1,0%	26,6%	21,1%	21,8%	59,8%	40,6%	54,9%
28.12.2009 bis 29.12.2014	19,7%	17,1%	15,6%	25,0%	20,3%	16,7%	29,3%	24,5%	19,2%
29.12.2014 bis 30.12.2019	5,9%	6,1%	11,1%	19,0%	16,2%	14,2%	30,3%	21,3%	19,4%
30.12.2019 bis 27.12.2021	24,1%	21,6%	23,6%	35,2%	29,4%	24,2%	37,0%	24,7%	34,2%

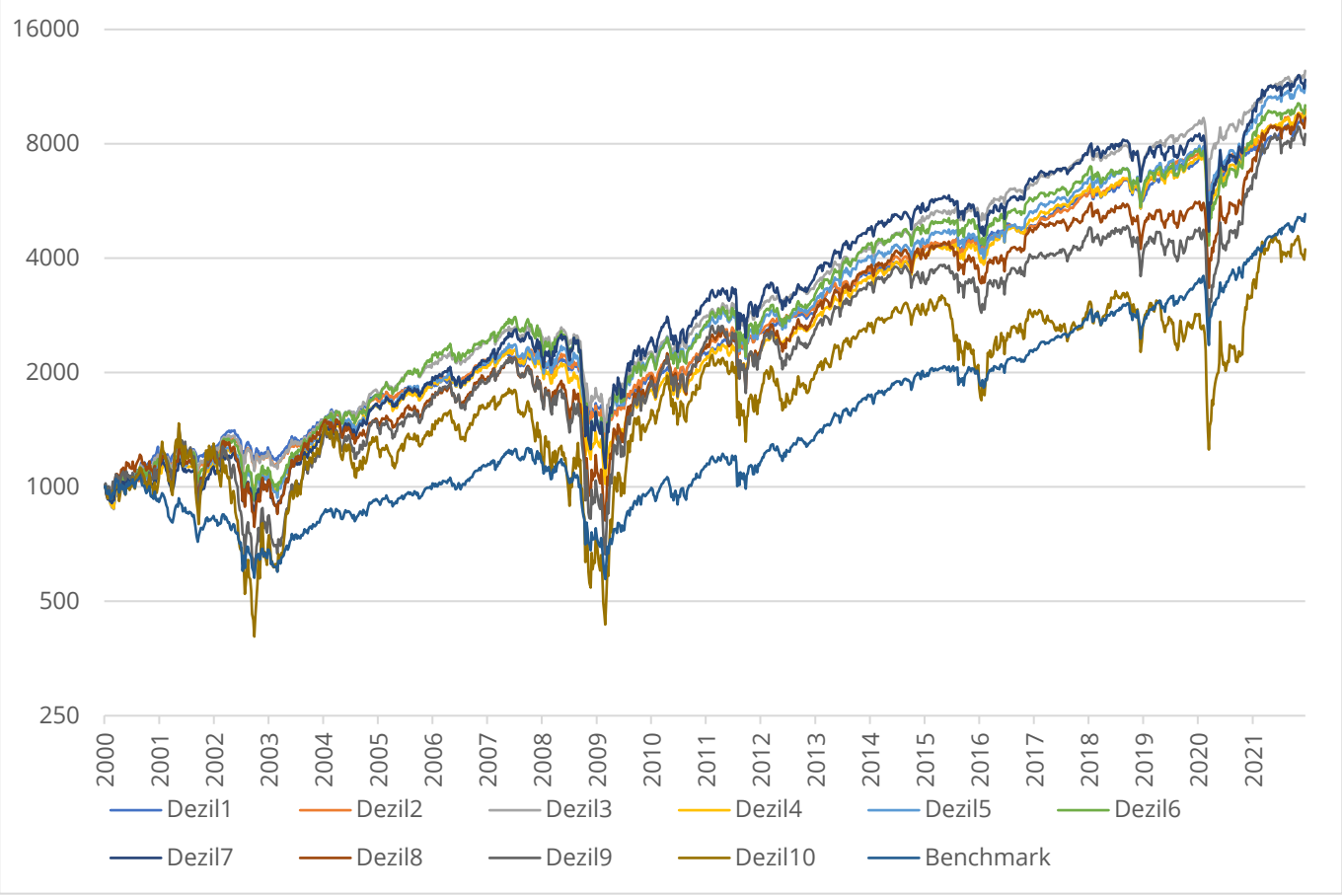
Safety-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	10.01.2000	Region:	USA (S&P 900)
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	S&P 900
Durchschnittliche Anzahl Aktien	889	Scoring-Modell:	Safety-Score

Dezilanalyse

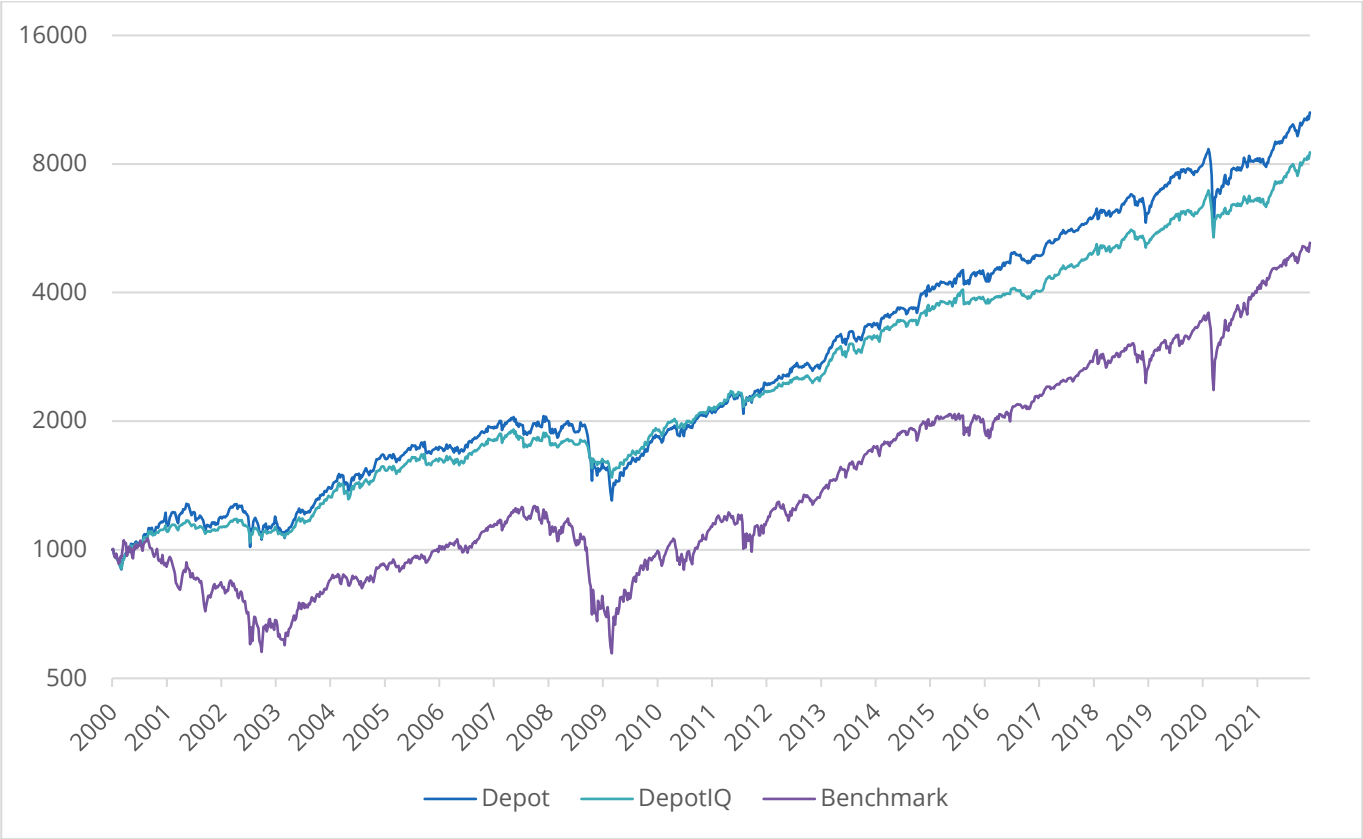
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	7,8%	10,7%	10,9%	12,1%	10,9%	11,7%	11,1%	11,9%	10,7%	10,2%	6,8%
Annualisierte Volatilität	18,8%	14,7%	16,0%	16,9%	18,8%	20,1%	22,2%	23,8%	25,4%	29,2%	37,8%
Maximaler Drawdown	54,9%	39,4%	45,7%	47,1%	55,8%	51,3%	58,0%	56,9%	62,8%	69,6%	76,1%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,415	0,732	0,683	0,715	0,581	0,583	0,499	0,499	0,421	0,349	0,179
Max 3 Jahre rollierend	117,6%	89,1%	109,7%	119,6%	139,3%	143,3%	147,8%	197,8%	211,9%	271,1%	343,2%
Min 3 Jahre rollierend	-44,0%	-27,4%	-33,7%	-35,6%	-46,5%	-39,1%	-47,3%	-42,7%	-53,9%	-62,9%	-70,9%
Max 5 Jahre rollierend	208,1%	169,4%	198,2%	211,1%	259,7%	255,3%	277,8%	338,9%	369,3%	432,0%	539,3%
Min 5 Jahre rollierend	-32,0%	-11,2%	-15,6%	-8,5%	-26,6%	-20,1%	-22,5%	-19,2%	-42,7%	-49,5%	-66,3%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	53,3%	62,0%	60,2%	69,3%	66,4%	58,8%	69,3%	54,4%	50,7%	46,7%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	11,3%	10,2%	7,8%
Annualisierte Volatilität	14,3%	10,2%	18,8%
Maximaler Drawdown	36,6%	22,8%	54,9%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,789	1,003	0,415
Max 3 Jahre rollierend	89,9%	65,1%	117,6%
Min 3 Jahre rollierend	-25,0%	-9,7%	-44,0%
Max 5 Jahre rollierend	166,7%	120,6%	208,1%
Min 5 Jahre rollierend	-11,6%	4,8%	-32,0%
Anteil Outperformance 1 Jahr	56,2%	51,1%	---

Anzahl Aktien im Depot	20	
Verkaufskriterium 1	Safety	80%
Verkaufskriterium 2	Safety	80%
Depotumschlagsfaktor	0,57	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
10.01.2000	bis	25.12.2000	25,7%	28,4%	9,3%
25.12.2000	bis	31.12.2001	11,2%	14,0%	30,9%
31.12.2001	bis	30.12.2002	18,2%	18,4%	-21,9%
30.12.2002	bis	29.12.2003	-7,2%	-5,9%	60,6%
29.12.2003	bis	27.12.2004	8,3%	5,2%	-0,8%
27.12.2004	bis	26.12.2005	-4,5%	-0,4%	-0,7%
26.12.2005	bis	25.12.2006	-1,2%	1,1%	0,6%
25.12.2006	bis	31.12.2007	-1,9%	-1,1%	-14,6%
31.12.2007	bis	29.12.2008	16,1%	9,8%	-12,7%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-13,8%	-8,3%	85,5%
28.12.2009	bis	27.12.2010	-0,7%	1,4%	17,8%
27.12.2010	bis	26.12.2011	13,9%	8,9%	-14,4%
26.12.2011	bis	31.12.2012	-7,5%	-2,4%	-1,2%
31.12.2012	bis	30.12.2013	-4,1%	-2,7%	6,7%
30.12.2013	bis	29.12.2014	6,9%	0,4%	-6,1%
29.12.2014	bis	28.12.2015	8,1%	3,7%	-20,3%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-4,5%	-4,4%	15,7%
26.12.2016	bis	25.12.2017	1,0%	-1,1%	-13,3%
25.12.2017	bis	31.12.2018	8,3%	3,7%	-11,4%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-2,0%	-3,6%	-10,4%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-13,9%	-10,6%	4,3%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-1,1%	-6,4%	5,1%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
10.01.2000	bis	27.12.2004	-1,5%	11,9%	11,4%	12,6%	10,4%	10,5%	11,9%	10,6%	8,7%	8,4%	6,3%
27.12.2004	bis	28.12.2009	1,0%	2,3%	3,1%	4,6%	1,8%	6,0%	4,6%	7,8%	4,4%	4,1%	2,1%
28.12.2009	bis	29.12.2014	15,6%	17,1%	16,7%	17,8%	18,6%	15,4%	17,3%	18,2%	17,6%	14,9%	15,1%
29.12.2014	bis	30.12.2019	11,1%	10,6%	11,5%	11,7%	11,6%	11,4%	9,3%	8,5%	5,7%	5,1%	-1,4%
30.12.2019	bis	27.12.2021	23,6%	15,2%	14,9%	17,7%	15,7%	21,4%	14,9%	18,5%	29,4%	34,2%	22,4%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
10.01.2000	bis	27.12.2004	19,2%	14,6%	15,1%	15,8%	17,5%	18,7%	19,4%	21,0%	23,7%	30,8%	41,8%
27.12.2004	bis	28.12.2009	21,8%	14,5%	17,9%	19,9%	22,3%	24,0%	27,4%	30,0%	31,5%	35,6%	45,5%
28.12.2009	bis	29.12.2014	16,7%	12,3%	14,2%	15,7%	17,1%	19,0%	20,4%	21,7%	23,4%	25,1%	28,6%
29.12.2014	bis	30.12.2019	14,2%	11,5%	11,8%	11,9%	13,3%	14,4%	16,0%	16,6%	17,6%	19,9%	27,9%
30.12.2019	bis	27.12.2021	24,2%	24,7%	24,5%	24,2%	26,4%	26,7%	30,7%	31,8%	32,9%	36,1%	47,1%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
10.01.2000	bis	27.12.2004	45,7%	20,2%	19,3%	20,1%	24,2%	26,9%	31,4%	32,6%	40,5%	59,2%	72,5%
27.12.2004	bis	28.12.2009	54,9%	39,4%	45,7%	47,1%	55,8%	51,3%	58,0%	56,9%	62,8%	69,6%	76,1%
28.12.2009	bis	29.12.2014	19,2%	13,0%	17,0%	17,5%	19,1%	25,3%	25,9%	26,3%	30,0%	33,4%	41,0%
29.12.2014	bis	30.12.2019	19,4%	16,2%	15,2%	16,9%	17,0%	19,2%	21,9%	22,4%	24,4%	26,2%	47,0%
30.12.2019	bis	27.12.2021	34,2%	35,4%	35,6%	35,0%	38,7%	36,8%	44,4%	44,7%	40,7%	44,9%	56,0%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
10.01.2000	bis	27.12.2004	10,9%	9,5%	-1,5%	14,0%	9,5%	19,2%	20,8%	12,0%	45,7%
27.12.2004	bis	28.12.2009	2,1%	4,2%	1,0%	14,5%	10,3%	21,8%	36,6%	22,8%	54,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	17,4%	14,1%	15,6%	10,8%	8,9%	16,7%	10,2%	8,1%	19,2%
29.12.2014	bis	30.12.2019	13,6%	11,0%	11,1%	11,4%	9,3%	14,2%	14,2%	9,3%	19,4%
30.12.2019	bis	27.12.2021	15,7%	16,1%	23,6%	24,9%	15,4%	24,2%	36,1%	22,4%	34,2%

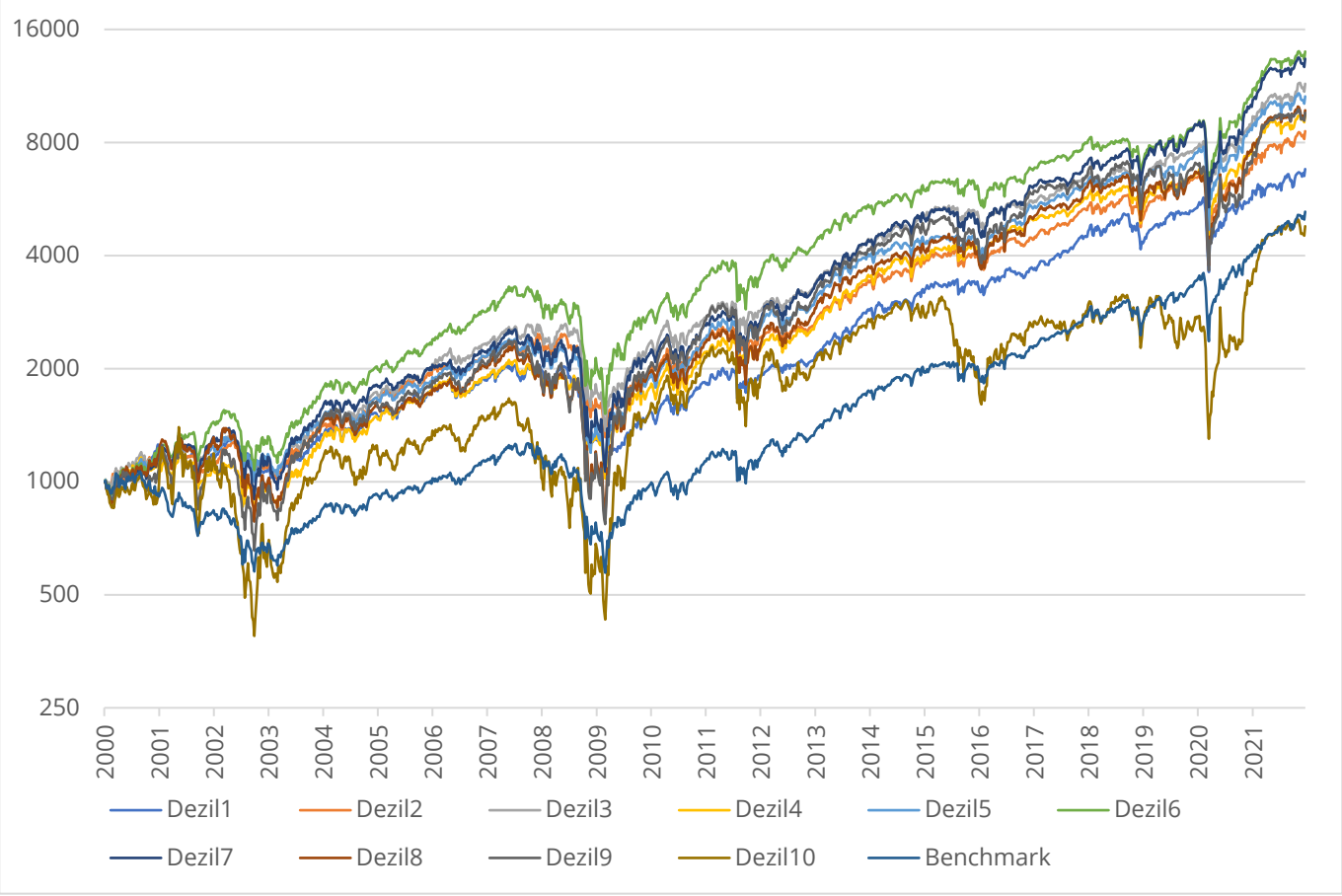
Technischer Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	10.01.2000	Region:	USA (S&P 900)
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	S&P 900
Durchschnittliche Anzahl Aktien	888	Scoring-Modell:	Technischer Score

Dezilanalyse

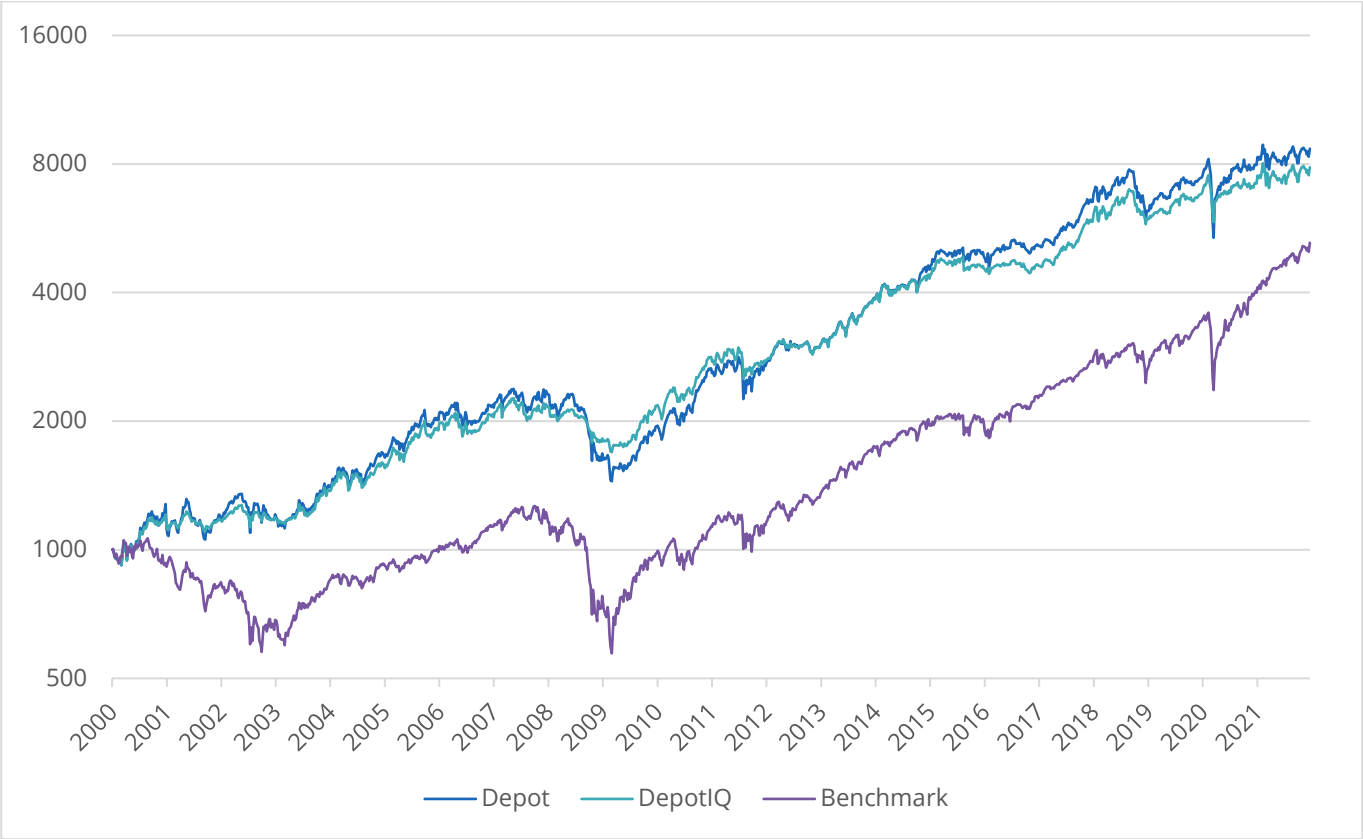
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	7,8%	9,1%	10,3%	11,7%	10,8%	11,3%	12,7%	12,5%	10,9%	10,8%	7,4%
Annualisierte Volatilität	18,8%	16,8%	18,2%	18,8%	19,7%	20,2%	20,8%	22,5%	24,6%	27,6%	36,5%
Maximaler Drawdown	54,9%	46,5%	46,9%	48,1%	51,7%	55,7%	54,2%	58,2%	64,6%	67,6%	74,3%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,415	0,541	0,563	0,623	0,546	0,561	0,613	0,554	0,443	0,392	0,202
Max 3 Jahre rollierend	117,6%	80,5%	97,5%	119,2%	133,6%	159,7%	153,7%	174,3%	213,7%	272,6%	389,2%
Min 3 Jahre rollierend	-44,0%	-38,6%	-34,0%	-35,1%	-43,9%	-45,4%	-38,2%	-47,7%	-54,6%	-59,1%	-68,9%
Max 5 Jahre rollierend	208,1%	167,7%	167,0%	226,3%	255,4%	280,5%	263,3%	324,0%	366,6%	455,8%	545,7%
Min 5 Jahre rollierend	-32,0%	-19,7%	-5,4%	-5,9%	-22,0%	-28,5%	-14,2%	-32,2%	-43,3%	-48,7%	-63,3%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	54,0%	52,6%	63,1%	61,7%	62,8%	64,2%	71,2%	60,6%	61,7%	44,9%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	10,3%	9,8%	7,8%
Annualisierte Volatilität	17,9%	13,6%	18,8%
Maximaler Drawdown	39,3%	25,3%	54,9%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,575	0,719	0,415
Max 3 Jahre rollierend	104,5%	76,1%	117,6%
Min 3 Jahre rollierend	-30,6%	-15,9%	-44,0%
Max 5 Jahre rollierend	187,3%	144,5%	208,1%
Min 5 Jahre rollierend	-6,7%	11,3%	-32,0%
Anteil Outperformance 1 Jahr	58,0%	53,3%	---

Anzahl Aktien im Depot	20	
Verkaufskriterium 1	Technisch	70%
Verkaufskriterium 2	Technisch	70%
Depotumschlagsfaktor	1,47	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
10.01.2000	bis	25.12.2000	30,2%	26,3%	3,0%
25.12.2000	bis	31.12.2001	8,7%	7,7%	28,1%
31.12.2001	bis	30.12.2002	18,9%	14,7%	-12,7%
30.12.2002	bis	29.12.2003	-8,5%	-1,6%	48,9%
29.12.2003	bis	27.12.2004	8,1%	5,8%	0,5%
27.12.2004	bis	26.12.2005	13,0%	7,0%	0,2%
26.12.2005	bis	25.12.2006	-6,9%	-4,2%	-0,8%
25.12.2006	bis	31.12.2007	1,5%	4,5%	-18,5%
31.12.2007	bis	29.12.2008	8,9%	3,9%	-10,1%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-13,9%	-11,5%	100,0%
28.12.2009	bis	27.12.2010	21,5%	4,5%	19,1%
27.12.2010	bis	26.12.2011	0,3%	1,0%	-10,9%
26.12.2011	bis	31.12.2012	-5,7%	-7,2%	0,8%
31.12.2012	bis	30.12.2013	-1,6%	2,9%	2,4%
30.12.2013	bis	29.12.2014	3,6%	-1,9%	-2,5%
29.12.2014	bis	28.12.2015	7,4%	3,8%	-21,5%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-8,9%	-3,5%	18,9%
26.12.2016	bis	25.12.2017	5,2%	-0,9%	-9,7%
25.12.2017	bis	31.12.2018	0,4%	1,0%	-9,0%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-11,3%	-4,9%	-12,7%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-10,4%	-11,6%	-4,6%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-20,9%	-7,2%	8,2%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
10.01.2000	bis	27.12.2004	-1,5%	8,8%	10,9%	11,7%	8,4%	10,9%	15,2%	12,7%	9,9%	10,3%	4,5%
27.12.2004	bis	28.12.2009	1,0%	0,1%	3,6%	6,1%	3,6%	2,6%	7,0%	3,9%	4,1%	4,4%	4,2%
28.12.2009	bis	29.12.2014	15,6%	16,3%	14,4%	17,2%	17,6%	18,7%	16,7%	18,8%	17,0%	19,2%	13,9%
29.12.2014	bis	30.12.2019	11,1%	10,4%	10,4%	8,3%	10,4%	10,8%	7,6%	11,4%	9,2%	7,5%	-1,6%
30.12.2019	bis	27.12.2021	23,6%	12,9%	15,4%	21,8%	20,2%	18,9%	25,3%	22,3%	20,9%	17,0%	32,8%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
10.01.2000	bis	27.12.2004	19,2%	16,4%	17,7%	17,8%	18,5%	17,9%	18,8%	20,5%	22,4%	28,1%	40,8%
27.12.2004	bis	28.12.2009	21,8%	17,4%	20,4%	21,4%	23,2%	24,2%	25,2%	28,3%	31,3%	34,3%	44,2%
28.12.2009	bis	29.12.2014	16,7%	15,3%	17,1%	18,3%	18,9%	18,9%	19,4%	19,8%	21,2%	21,8%	26,6%
29.12.2014	bis	30.12.2019	14,2%	12,9%	12,9%	12,8%	13,4%	14,1%	15,1%	15,9%	17,6%	19,6%	27,4%
30.12.2019	bis	27.12.2021	24,2%	26,1%	26,4%	26,7%	27,2%	28,7%	28,0%	30,6%	32,9%	36,6%	44,5%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
10.01.2000	bis	27.12.2004	45,7%	22,1%	20,6%	23,5%	29,5%	24,0%	30,8%	35,2%	43,7%	49,5%	72,2%
27.12.2004	bis	28.12.2009	54,9%	46,5%	46,9%	48,1%	51,7%	55,7%	54,2%	58,2%	64,6%	67,6%	74,3%
28.12.2009	bis	29.12.2014	19,2%	17,2%	18,3%	18,8%	20,1%	21,4%	25,7%	24,3%	28,7%	30,7%	38,4%
29.12.2014	bis	30.12.2019	19,4%	19,6%	18,0%	17,0%	20,3%	17,0%	21,7%	19,9%	24,4%	25,4%	48,4%
30.12.2019	bis	27.12.2021	34,2%	36,7%	38,1%	35,8%	37,0%	39,9%	38,5%	41,0%	43,8%	48,2%	52,9%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
10.01.2000	bis	27.12.2004	11,0%	9,8%	-1,5%	18,4%	13,0%	19,2%	19,6%	11,2%	45,7%
27.12.2004	bis	28.12.2009	2,9%	6,4%	1,0%	17,1%	13,6%	21,8%	39,3%	25,3%	54,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	18,9%	15,2%	15,6%	16,5%	13,0%	16,7%	20,4%	15,6%	19,2%
29.12.2014	bis	30.12.2019	9,9%	9,0%	11,1%	13,7%	11,4%	14,2%	24,4%	17,1%	19,4%
30.12.2019	bis	27.12.2021	8,2%	7,5%	23,6%	28,5%	20,6%	24,2%	34,6%	22,4%	34,2%

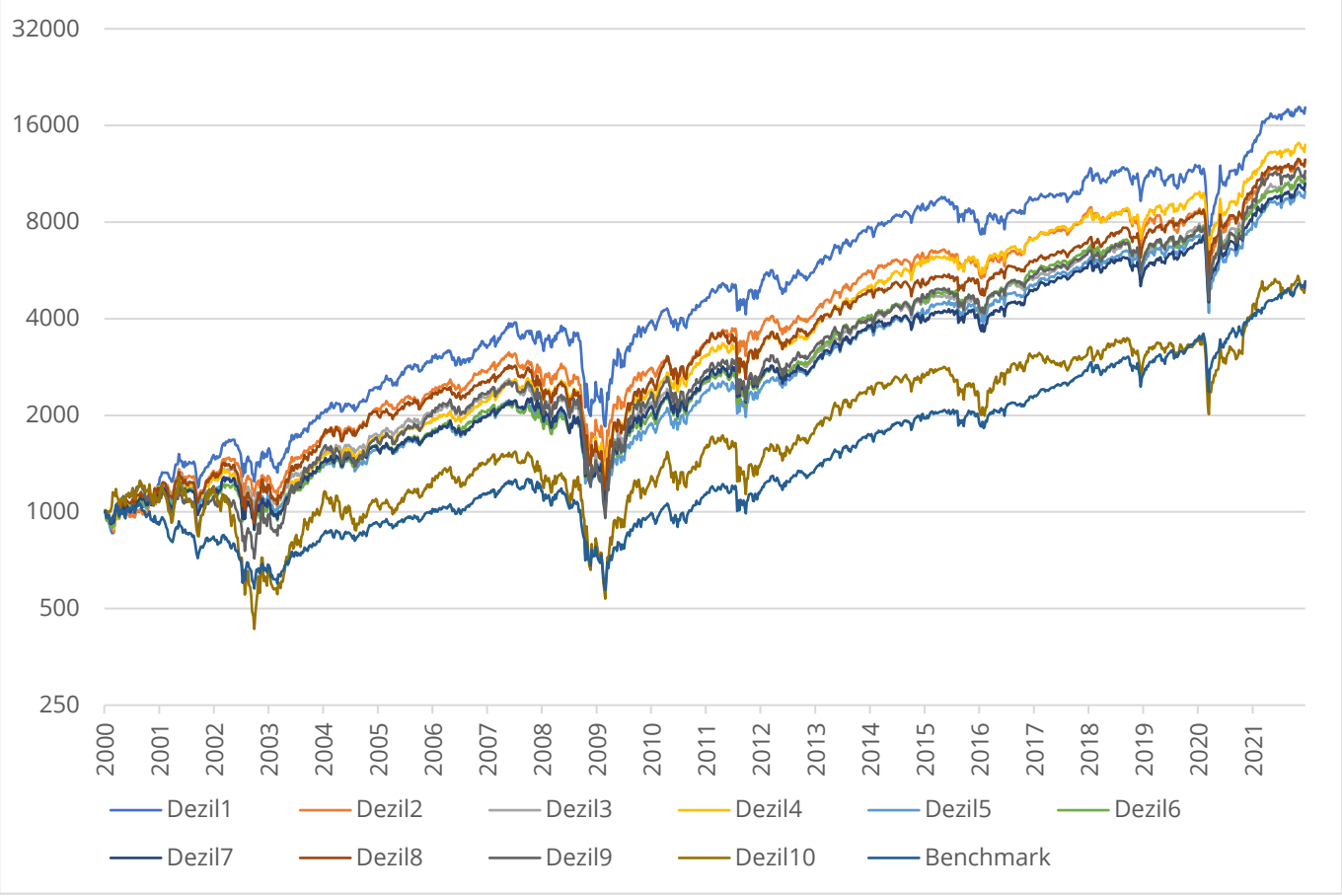
Value-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	10.01.2000	Region:	USA (S&P 900)
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	S&P 900
Durchschnittliche Anzahl Aktien	865	Scoring-Modell:	Value-Score

Dezilanalyse

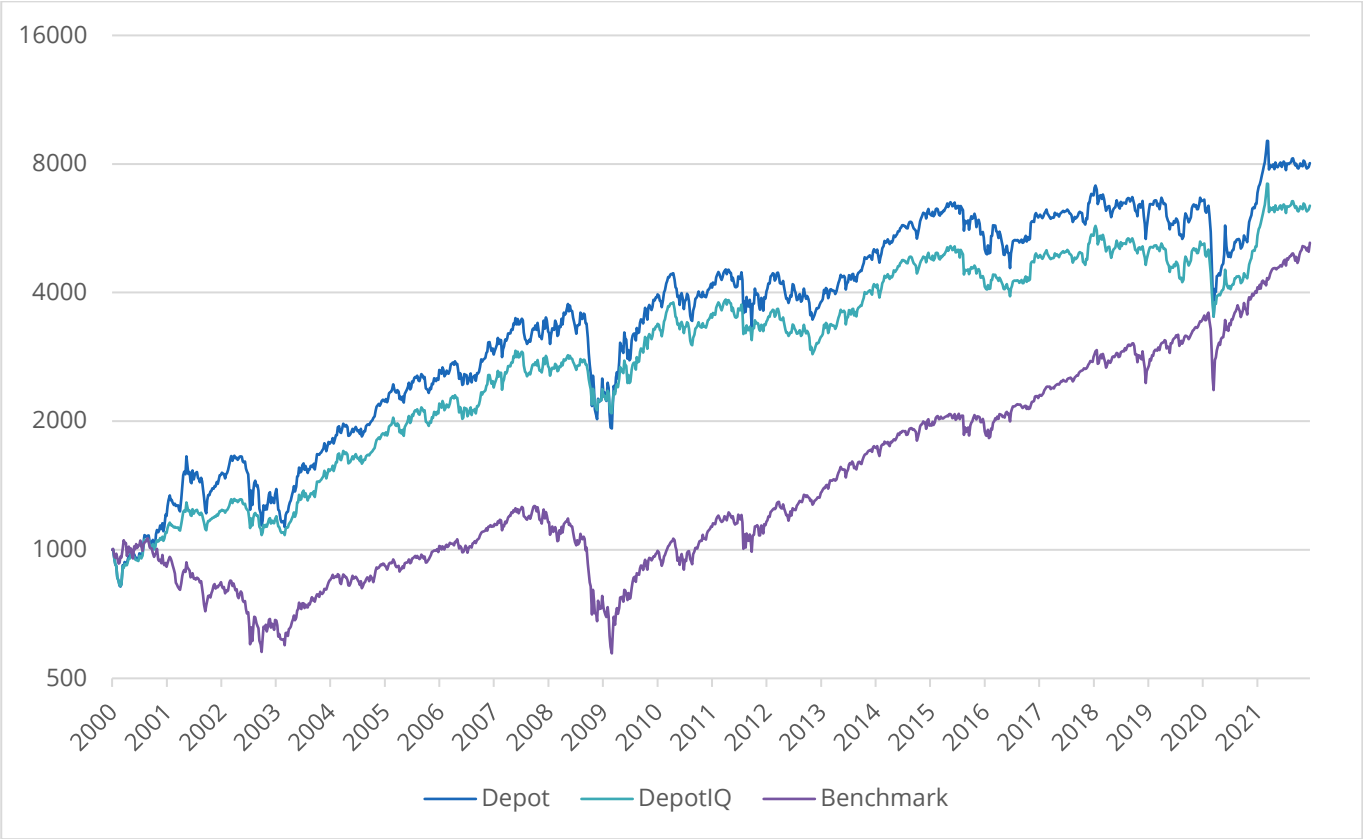
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	7,8%	14,1%	12,2%	11,5%	12,7%	11,0%	11,5%	11,3%	12,2%	11,7%	7,7%
Annualisierte Volatilität	18,8%	22,6%	20,4%	19,9%	20,0%	20,0%	19,8%	20,7%	22,2%	23,9%	29,4%
Maximaler Drawdown	54,9%	52,7%	54,3%	57,8%	50,6%	54,4%	51,5%	52,1%	59,0%	62,6%	66,3%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,415	0,624	0,597	0,579	0,634	0,551	0,582	0,546	0,548	0,492	0,262
Max 3 Jahre rollierend	117,6%	197,4%	175,0%	151,9%	168,4%	148,7%	156,1%	154,3%	196,4%	208,4%	189,0%
Min 3 Jahre rollierend	-44,0%	-38,9%	-41,5%	-47,4%	-35,0%	-43,9%	-41,7%	-40,5%	-50,4%	-55,2%	-59,0%
Max 5 Jahre rollierend	208,1%	323,1%	300,3%	273,4%	301,7%	270,4%	291,9%	260,0%	317,2%	336,1%	368,8%
Min 5 Jahre rollierend	-32,0%	-28,8%	-19,4%	-28,7%	-14,8%	-27,1%	-24,7%	-24,1%	-32,2%	-35,6%	-47,6%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	69,3%	64,2%	60,2%	77,7%	67,5%	65,7%	63,1%	58,0%	60,6%	48,2%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	9,9%	8,8%	7,8%
Annualisierte Volatilität	24,8%	17,8%	18,8%
Maximaler Drawdown	50,7%	38,7%	54,9%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,400	0,492	0,415
Max 3 Jahre rollierend	129,3%	100,8%	117,6%
Min 3 Jahre rollierend	-41,0%	-26,7%	-44,0%
Max 5 Jahre rollierend	198,6%	159,0%	208,1%
Min 5 Jahre rollierend	-42,7%	-27,5%	-32,0%
Anteil Outperformance 1 Jahr	55,8%	54,7%	---

Anzahl Aktien im Depot	20	
Verkaufskriterium 1	Value	90%
Verkaufskriterium 2	Value	90%
Depotumschlagsfaktor	0,63	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
10.01.2000	bis	25.12.2000	21,2%	20,2%	16,2%
25.12.2000	bis	31.12.2001	42,0%	34,9%	14,1%
31.12.2001	bis	30.12.2002	7,7%	18,6%	-11,7%
30.12.2002	bis	29.12.2003	9,8%	8,5%	43,5%
29.12.2003	bis	27.12.2004	14,7%	10,6%	-2,1%
27.12.2004	bis	26.12.2005	4,5%	8,8%	6,5%
26.12.2005	bis	25.12.2006	2,9%	0,4%	2,4%
25.12.2006	bis	31.12.2007	11,4%	-1,2%	-9,1%
31.12.2007	bis	29.12.2008	4,5%	1,8%	-3,8%
29.12.2008	bis	28.12.2009	39,8%	33,9%	33,4%
28.12.2009	bis	27.12.2010	-8,7%	3,5%	8,3%
27.12.2010	bis	26.12.2011	-7,8%	5,9%	-8,9%
26.12.2011	bis	31.12.2012	-19,6%	-2,0%	7,9%
31.12.2012	bis	30.12.2013	3,1%	6,4%	0,4%
30.12.2013	bis	29.12.2014	8,8%	0,0%	-0,7%
29.12.2014	bis	28.12.2015	-11,9%	-9,3%	-7,7%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-4,1%	4,4%	9,9%
26.12.2016	bis	25.12.2017	-7,9%	-1,3%	-11,9%
25.12.2017	bis	31.12.2018	-11,5%	-8,0%	-3,7%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-15,4%	-10,9%	-5,2%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-19,2%	-6,0%	2,3%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-5,2%	3,5%	-2,9%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
10.01.2000	bis	27.12.2004	-1,5%	19,7%	16,1%	11,9%	11,4%	9,5%	10,2%	10,0%	15,6%	11,3%	1,9%
27.12.2004	bis	28.12.2009	1,0%	9,7%	5,8%	4,4%	6,8%	3,5%	4,2%	5,6%	4,2%	5,7%	2,3%
28.12.2009	bis	29.12.2014	15,6%	18,5%	18,0%	16,3%	20,9%	18,1%	18,6%	14,1%	15,9%	16,1%	16,9%
29.12.2014	bis	30.12.2019	11,1%	5,5%	6,0%	10,6%	9,7%	10,9%	9,8%	10,8%	9,9%	9,5%	4,7%
30.12.2019	bis	27.12.2021	23,6%	23,5%	20,7%	19,6%	19,4%	17,6%	21,0%	24,0%	21,2%	24,0%	22,8%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
10.01.2000	bis	27.12.2004	19,2%	19,4%	18,0%	17,1%	18,5%	18,4%	18,6%	19,6%	20,7%	24,3%	34,9%
27.12.2004	bis	28.12.2009	21,8%	28,9%	25,0%	24,5%	23,1%	22,9%	22,6%	24,7%	27,5%	29,3%	33,7%
28.12.2009	bis	29.12.2014	16,7%	18,2%	17,5%	17,3%	18,2%	18,2%	18,7%	19,7%	21,2%	21,4%	24,2%
29.12.2014	bis	30.12.2019	14,2%	17,8%	15,8%	15,0%	14,7%	14,3%	14,2%	14,4%	14,1%	14,7%	19,6%
30.12.2019	bis	27.12.2021	24,2%	31,1%	28,3%	28,5%	29,6%	30,1%	28,2%	27,3%	29,0%	31,1%	34,7%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
10.01.2000	bis	27.12.2004	45,7%	25,9%	24,2%	24,4%	30,2%	26,0%	28,8%	31,5%	35,2%	41,7%	66,3%
27.12.2004	bis	28.12.2009	54,9%	52,7%	54,3%	57,8%	50,6%	54,4%	51,5%	52,1%	59,0%	62,6%	65,2%
28.12.2009	bis	29.12.2014	19,2%	20,1%	18,1%	22,3%	21,1%	22,5%	23,0%	22,9%	28,9%	25,8%	34,5%
29.12.2014	bis	30.12.2019	19,4%	23,6%	23,7%	21,5%	19,8%	18,1%	21,2%	18,8%	19,4%	20,1%	29,8%
30.12.2019	bis	27.12.2021	34,2%	45,0%	40,9%	40,5%	40,7%	42,9%	39,6%	37,9%	38,4%	41,3%	41,6%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
10.01.2000	bis	27.12.2004	17,6%	13,4%	-1,5%	22,6%	14,9%	19,2%	31,9%	17,8%	45,7%
27.12.2004	bis	28.12.2009	11,6%	12,1%	1,0%	29,7%	20,5%	21,8%	48,8%	28,5%	54,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	10,0%	8,3%	15,6%	21,6%	16,6%	16,7%	26,6%	25,5%	19,2%
29.12.2014	bis	30.12.2019	0,8%	0,8%	11,1%	20,3%	16,3%	14,2%	29,9%	26,2%	19,4%
30.12.2019	bis	27.12.2021	10,9%	11,2%	23,6%	33,2%	23,4%	24,2%	46,8%	32,7%	34,2%

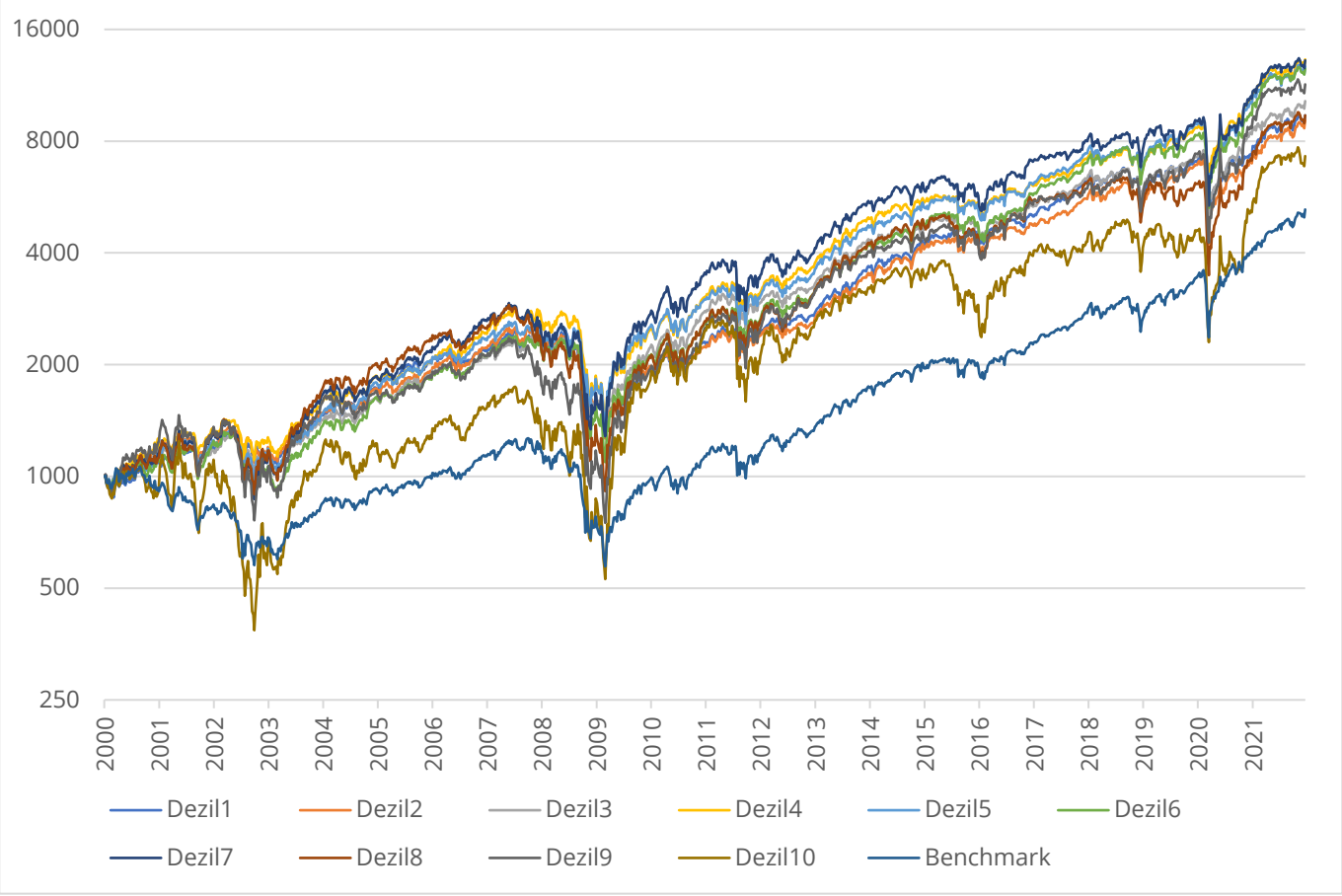
Kombi-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	10.01.2000	Region:	USA (S&P 900)
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	S&P 900
Durchschnittliche Anzahl Aktien	864	Scoring-Modell:	Kombi-Score

Dezilanalyse

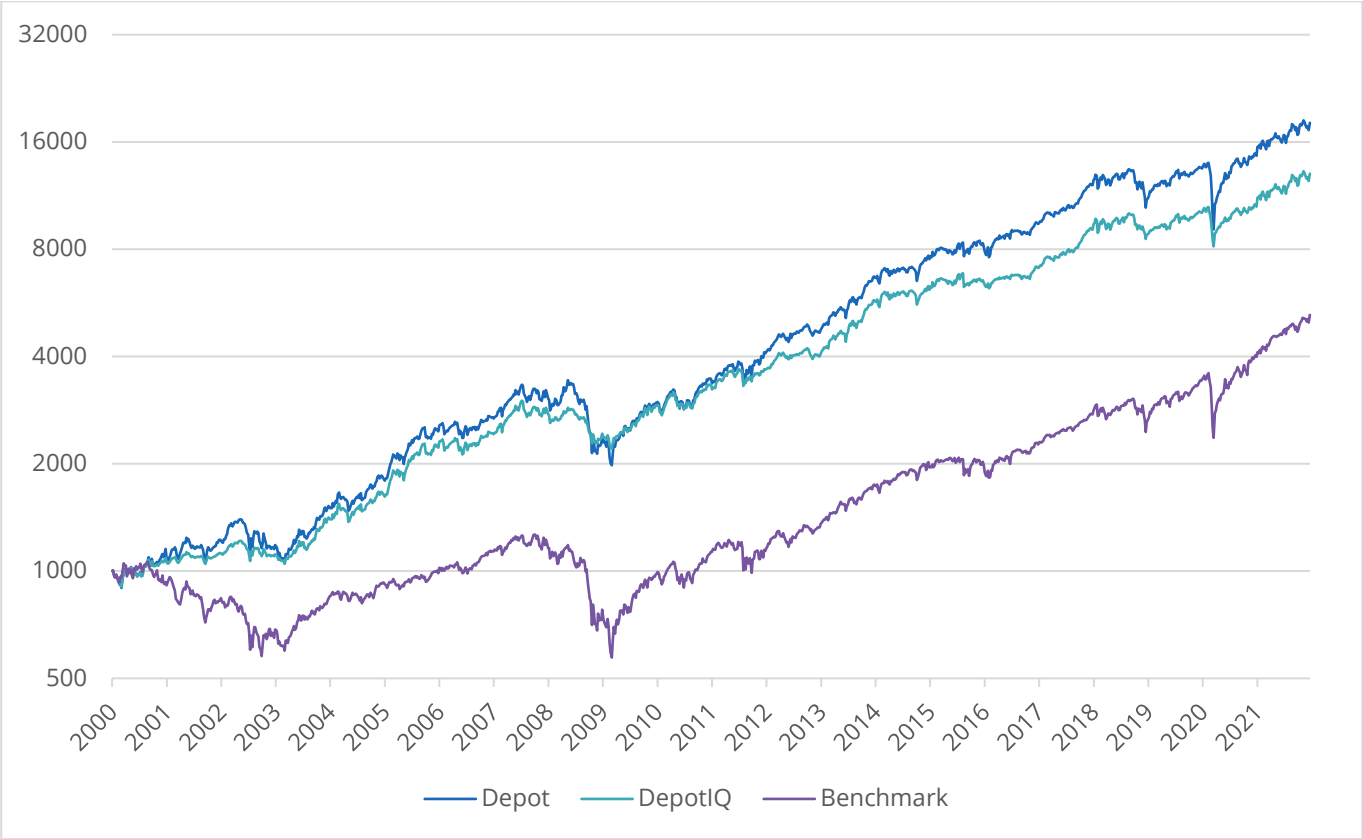
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	7,8%	10,7%	10,6%	11,1%	12,5%	12,2%	12,2%	12,4%	10,7%	11,7%	9,4%
Annualisierte Volatilität	18,8%	17,0%	17,7%	18,0%	18,9%	20,1%	21,4%	23,4%	24,9%	26,2%	34,1%
Maximaler Drawdown	54,9%	46,3%	49,9%	45,1%	50,4%	48,1%	54,2%	56,3%	68,6%	68,2%	69,7%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,415	0,630	0,596	0,619	0,660	0,610	0,569	0,531	0,430	0,445	0,277
Max 3 Jahre rollierend	117,6%	94,7%	97,8%	133,8%	140,5%	141,9%	163,9%	195,2%	207,5%	266,8%	352,5%
Min 3 Jahre rollierend	-44,0%	-36,8%	-37,0%	-31,8%	-34,8%	-35,5%	-43,0%	-44,8%	-62,2%	-61,6%	-61,7%
Max 5 Jahre rollierend	208,1%	186,1%	187,4%	233,2%	261,7%	254,2%	287,6%	331,5%	377,6%	449,1%	541,0%
Min 5 Jahre rollierend	-32,0%	-13,8%	-15,2%	-8,4%	-13,1%	-10,0%	-19,1%	-24,0%	-47,1%	-52,0%	-55,1%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	59,1%	59,1%	53,7%	69,3%	68,3%	76,3%	62,4%	55,8%	55,5%	51,1%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	14,0%	12,3%	7,8%
Annualisierte Volatilität	17,6%	13,3%	18,8%
Maximaler Drawdown	42,2%	26,7%	54,9%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,796	0,929	0,415
Max 3 Jahre rollierend	134,7%	115,6%	117,6%
Min 3 Jahre rollierend	-20,6%	-4,5%	-44,0%
Max 5 Jahre rollierend	253,9%	181,9%	208,1%
Min 5 Jahre rollierend	12,8%	23,1%	-32,0%
Anteil Outperformance 1 Jahr	69,3%	60,2%	---

Anzahl Aktien im Depot	20	
Verkaufskriterium 1	Kombi	70%
Verkaufskriterium 2	Kombi	70%
Depotumschlagsfaktor	0,95	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
10.01.2000	bis	25.12.2000	19,0%	24,8%	11,7%
25.12.2000	bis	31.12.2001	20,4%	14,1%	24,3%
31.12.2001	bis	30.12.2002	15,7%	16,2%	-14,0%
30.12.2002	bis	29.12.2003	2,8%	-0,5%	51,1%
29.12.2003	bis	27.12.2004	9,5%	6,2%	-2,7%
27.12.2004	bis	26.12.2005	28,8%	6,6%	-0,6%
26.12.2005	bis	25.12.2006	-5,2%	-2,1%	2,1%
25.12.2006	bis	31.12.2007	10,7%	3,5%	-14,9%
31.12.2007	bis	29.12.2008	11,7%	3,7%	-6,5%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-3,9%	-7,5%	79,5%
28.12.2009	bis	27.12.2010	2,2%	0,6%	16,1%
27.12.2010	bis	26.12.2011	16,2%	4,4%	-10,4%
26.12.2011	bis	31.12.2012	-2,1%	-6,0%	9,1%
31.12.2012	bis	30.12.2013	11,9%	4,5%	-2,2%
30.12.2013	bis	29.12.2014	-1,0%	2,9%	-3,3%
29.12.2014	bis	28.12.2015	8,0%	4,2%	-12,6%
28.12.2015	bis	26.12.2016	0,9%	-2,5%	17,8%
26.12.2016	bis	25.12.2017	7,5%	-1,0%	-11,4%
25.12.2017	bis	31.12.2018	-4,1%	-0,9%	-4,6%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-8,0%	-4,7%	-3,0%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-8,3%	-14,3%	-1,6%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-7,6%	-1,6%	5,2%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
10.01.2000	bis	27.12.2004	-1,5%	11,7%	11,6%	10,3%	13,4%	12,5%	10,4%	13,3%	15,1%	11,3%	4,2%
27.12.2004	bis	28.12.2009	1,0%	2,3%	2,8%	6,3%	5,8%	7,0%	5,3%	7,8%	0,8%	2,6%	7,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	15,6%	17,3%	16,3%	16,4%	17,7%	16,7%	18,3%	17,8%	18,6%	18,5%	15,0%
29.12.2014	bis	30.12.2019	11,1%	10,2%	10,3%	8,8%	9,1%	10,2%	11,0%	8,0%	4,5%	10,2%	4,8%
30.12.2019	bis	27.12.2021	23,6%	15,3%	15,0%	18,9%	23,6%	19,4%	23,0%	20,7%	23,7%	24,1%	26,2%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
10.01.2000	bis	27.12.2004	19,2%	16,3%	16,0%	16,5%	17,0%	18,1%	19,6%	21,8%	22,8%	25,9%	38,7%
27.12.2004	bis	28.12.2009	21,8%	19,0%	19,8%	19,8%	22,7%	24,3%	26,6%	28,3%	31,4%	33,1%	40,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	16,7%	15,3%	16,4%	17,3%	17,5%	18,8%	19,5%	21,2%	21,4%	22,2%	26,1%
29.12.2014	bis	30.12.2019	14,2%	12,8%	13,0%	13,3%	13,4%	13,7%	14,9%	16,7%	17,9%	17,6%	24,1%
30.12.2019	bis	27.12.2021	24,2%	24,9%	27,2%	26,9%	26,5%	28,2%	28,2%	32,1%	33,8%	34,0%	41,5%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
10.01.2000	bis	27.12.2004	45,7%	20,8%	20,4%	22,2%	23,0%	25,8%	33,8%	38,3%	37,2%	47,9%	69,1%
27.12.2004	bis	28.12.2009	54,9%	46,3%	49,9%	45,1%	50,4%	48,1%	54,2%	56,3%	68,6%	68,2%	69,7%
28.12.2009	bis	29.12.2014	19,2%	17,2%	17,4%	19,5%	19,7%	21,4%	23,2%	27,2%	26,7%	28,7%	40,1%
29.12.2014	bis	30.12.2019	19,4%	19,2%	18,7%	18,6%	17,8%	18,2%	20,6%	19,4%	24,4%	22,9%	37,9%
30.12.2019	bis	27.12.2021	34,2%	36,7%	40,9%	38,4%	35,2%	40,5%	37,2%	42,3%	44,3%	43,3%	50,5%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
10.01.2000	bis	27.12.2004	12,9%	10,6%	-1,5%	17,4%	12,3%	19,2%	24,8%	13,6%	45,7%
27.12.2004	bis	28.12.2009	10,1%	12,0%	1,0%	19,8%	14,6%	21,8%	42,2%	26,7%	54,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	20,9%	16,6%	15,6%	14,8%	12,1%	16,7%	13,8%	10,4%	19,2%
29.12.2014	bis	30.12.2019	11,9%	10,0%	11,1%	14,3%	11,8%	14,2%	22,1%	15,3%	19,4%
30.12.2019	bis	27.12.2021	15,7%	13,3%	23,6%	25,3%	18,0%	24,2%	35,0%	22,4%	34,2%

Kanada – TSX Composite

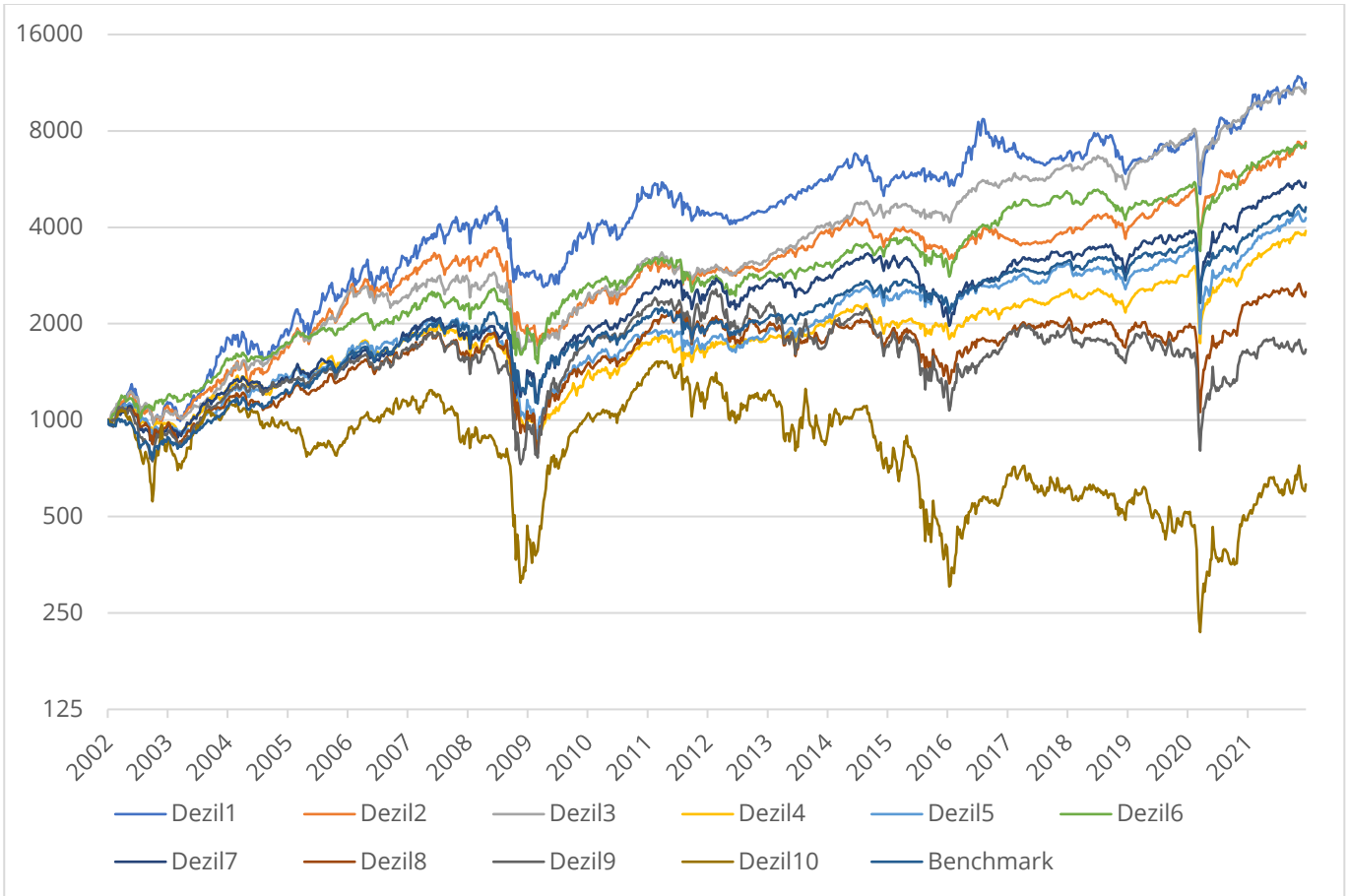
Trend-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Kanada
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	TSX Composite
Durchschnittliche Anzahl Aktien	234	Scoring-Modell:	Trend-Score

Dezilanalyse

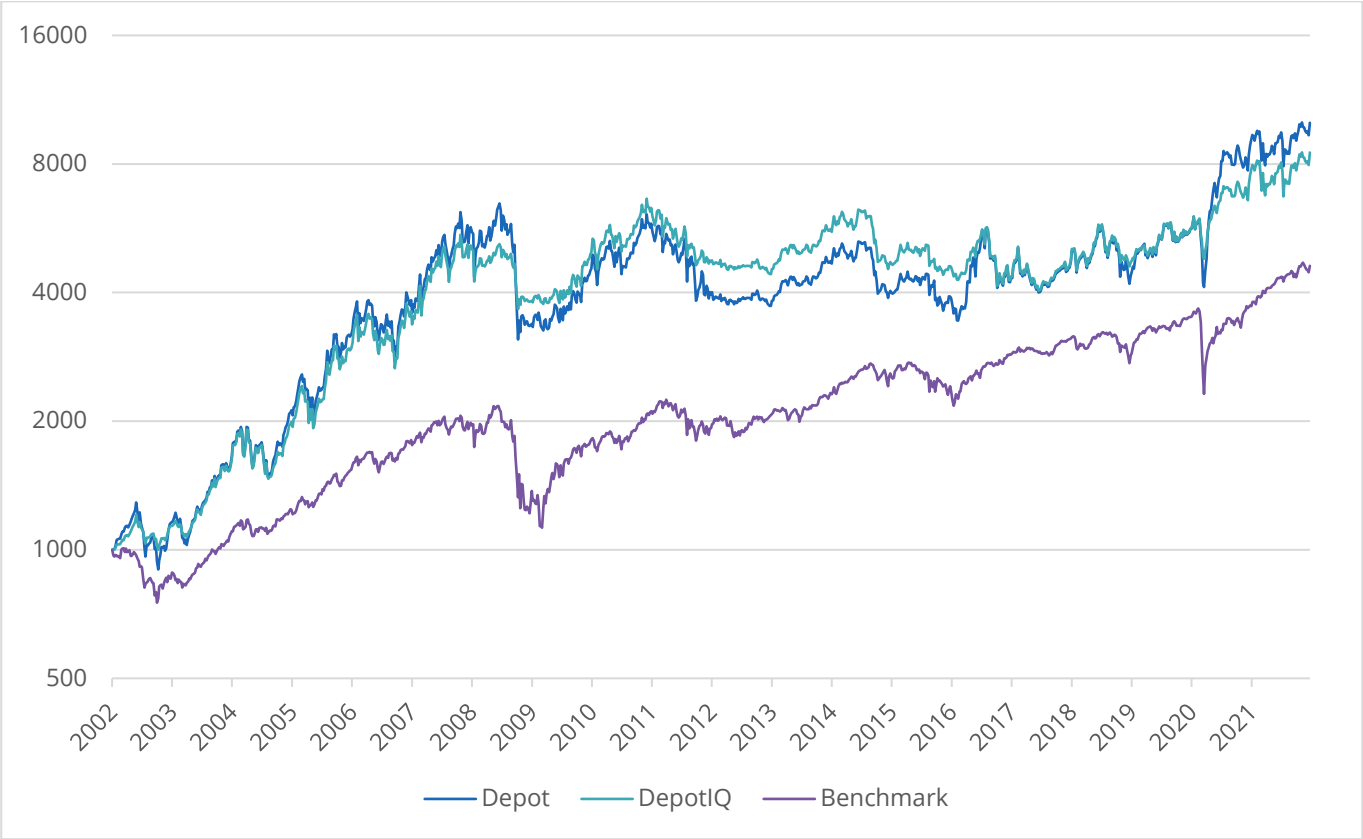
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	7,9%	12,9%	10,5%	12,6%	7,0%	7,5%	10,5%	8,9%	4,7%	2,6%	-2,3%
Annualisierte Volatilität	17,5%	23,4%	18,1%	16,6%	17,2%	18,2%	17,6%	18,9%	21,3%	25,3%	34,6%
Maximaler Drawdown	48,1%	44,0%	50,5%	44,1%	58,8%	58,1%	41,5%	45,0%	58,0%	68,7%	85,8%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,453	0,549	0,579	0,759	0,410	0,414	0,595	0,469	0,222	0,102	-0,066
Max 3 Jahre rollierend	100,8%	192,6%	162,1%	154,1%	108,5%	106,9%	86,6%	138,4%	162,9%	221,9%	282,0%
Min 3 Jahre rollierend	-31,0%	-22,6%	-33,2%	-34,9%	-51,4%	-48,0%	-28,7%	-28,7%	-47,1%	-58,9%	-75,6%
Max 5 Jahre rollierend	169,2%	333,5%	221,5%	180,4%	156,7%	163,9%	144,0%	155,6%	152,7%	167,7%	197,7%
Min 5 Jahre rollierend	-12,5%	-12,3%	-14,4%	4,2%	-38,3%	-30,3%	-8,8%	-23,5%	-40,3%	-53,0%	-79,1%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	66,5%	62,5%	69,4%	39,9%	46,8%	50,8%	57,3%	35,5%	32,7%	33,5%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	12,2%	11,3%	7,9%
Annualisierte Volatilität	28,8%	23,8%	17,5%
Maximaler Drawdown	52,0%	39,0%	48,1%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,422	0,473	0,453
Max 3 Jahre rollierend	259,6%	241,2%	100,8%
Min 3 Jahre rollierend	-27,3%	-35,2%	-31,0%
Max 5 Jahre rollierend	530,0%	413,6%	169,2%
Min 5 Jahre rollierend	-39,9%	-31,9%	-12,5%
Anteil Outperformance 1 Jahr	56,9%	53,2%	---

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Trend	70%
Verkaufskriterium 2	Trend	70%
Depotumschlagsfaktor	1,83	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	29,9%	25,3%	-0,8%
30.12.2002	bis	29.12.2003	10,1%	15,3%	6,9%
29.12.2003	bis	27.12.2004	17,7%	1,0%	-13,0%
27.12.2004	bis	26.12.2005	27,3%	9,6%	-22,3%
26.12.2005	bis	25.12.2006	2,7%	7,4%	5,0%
25.12.2006	bis	31.12.2007	40,8%	11,3%	-24,6%
31.12.2007	bis	29.12.2008	-5,4%	1,2%	-15,6%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-6,3%	-13,7%	95,3%
28.12.2009	bis	27.12.2010	9,2%	13,6%	15,5%
27.12.2010	bis	26.12.2011	-20,9%	-0,7%	-1,9%
26.12.2011	bis	31.12.2012	-14,8%	-4,6%	-3,9%
31.12.2012	bis	30.12.2013	14,7%	15,4%	-38,3%
30.12.2013	bis	29.12.2014	-26,1%	-15,9%	-18,0%
29.12.2014	bis	28.12.2015	3,6%	7,6%	-27,5%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-10,6%	-6,7%	24,7%
26.12.2016	bis	25.12.2017	-0,2%	-8,5%	-5,5%
25.12.2017	bis	31.12.2018	4,1%	4,5%	-6,7%
31.12.2018	bis	30.12.2019	5,2%	4,0%	-22,0%
30.12.2019	bis	28.12.2020	51,1%	9,1%	-10,4%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-10,9%	5,2%	-7,8%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002 bis 27.12.2004	7,7%	24,4%	19,7%	20,4%	10,7%	11,8%	20,6%	10,8%	6,7%	10,3%	-0,7%
27.12.2004 bis 28.12.2009	7,5%	15,0%	6,5%	6,5%	0,3%	2,0%	8,5%	7,5%	3,9%	5,5%	0,9%
28.12.2009 bis 29.12.2014	7,6%	7,0%	9,4%	13,5%	7,6%	9,6%	5,7%	10,0%	3,6%	-0,7%	-5,7%
29.12.2014 bis 30.12.2019	6,3%	6,8%	6,3%	11,0%	7,1%	6,6%	8,9%	4,0%	2,2%	-0,2%	-7,6%
30.12.2019 bis 27.12.2021	14,8%	22,6%	21,5%	19,1%	17,8%	13,0%	17,4%	19,9%	13,3%	-0,3%	10,9%

Annualisierte Volatilität	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002 bis 27.12.2004	13,5%	20,7%	15,9%	12,7%	12,4%	11,8%	11,2%	13,7%	14,7%	15,4%	25,9%
27.12.2004 bis 28.12.2009	24,0%	29,1%	23,8%	22,4%	21,9%	23,6%	22,4%	23,7%	25,0%	28,5%	35,4%
28.12.2009 bis 29.12.2014	13,8%	19,6%	14,9%	13,4%	14,4%	13,5%	14,8%	15,5%	18,6%	22,7%	30,5%
29.12.2014 bis 30.12.2019	11,9%	19,1%	11,7%	11,4%	11,6%	12,2%	13,8%	15,7%	18,6%	24,4%	37,1%
30.12.2019 bis 27.12.2021	23,0%	29,5%	24,6%	22,2%	25,8%	29,9%	25,1%	26,4%	30,3%	35,2%	45,4%

Maximaler Drawdown	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002 bis 27.12.2004	25,5%	25,4%	20,4%	20,6%	20,5%	20,1%	15,0%	23,5%	24,9%	32,4%	48,3%
27.12.2004 bis 28.12.2009	48,1%	44,0%	50,5%	44,1%	58,8%	58,1%	41,5%	45,0%	58,0%	61,3%	75,0%
28.12.2009 bis 29.12.2014	19,8%	26,4%	18,9%	19,8%	19,8%	15,6%	23,9%	19,8%	28,4%	38,1%	53,7%
29.12.2014 bis 30.12.2019	20,7%	32,6%	20,6%	21,4%	15,6%	16,8%	24,8%	39,6%	32,9%	43,0%	66,2%
30.12.2019 bis 27.12.2021	36,9%	36,0%	33,6%	33,3%	42,6%	46,2%	39,1%	39,7%	47,0%	52,1%	58,0%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum	Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002 bis 27.12.2004	28,2%	25,5%	7,7%	24,0%	20,0%	13,5%	30,4%	23,4%	25,5%
27.12.2004 bis 28.12.2009	16,5%	20,0%	7,5%	36,4%	30,0%	24,0%	52,0%	33,0%	48,1%
28.12.2009 bis 29.12.2014	-2,2%	-0,8%	7,6%	23,8%	19,9%	13,8%	38,9%	33,4%	19,8%
29.12.2014 bis 30.12.2019	6,8%	3,7%	6,3%	25,0%	20,9%	11,9%	29,1%	28,9%	20,7%
30.12.2019 bis 27.12.2021	33,3%	22,7%	14,8%	34,1%	27,7%	23,0%	31,4%	20,5%	36,9%

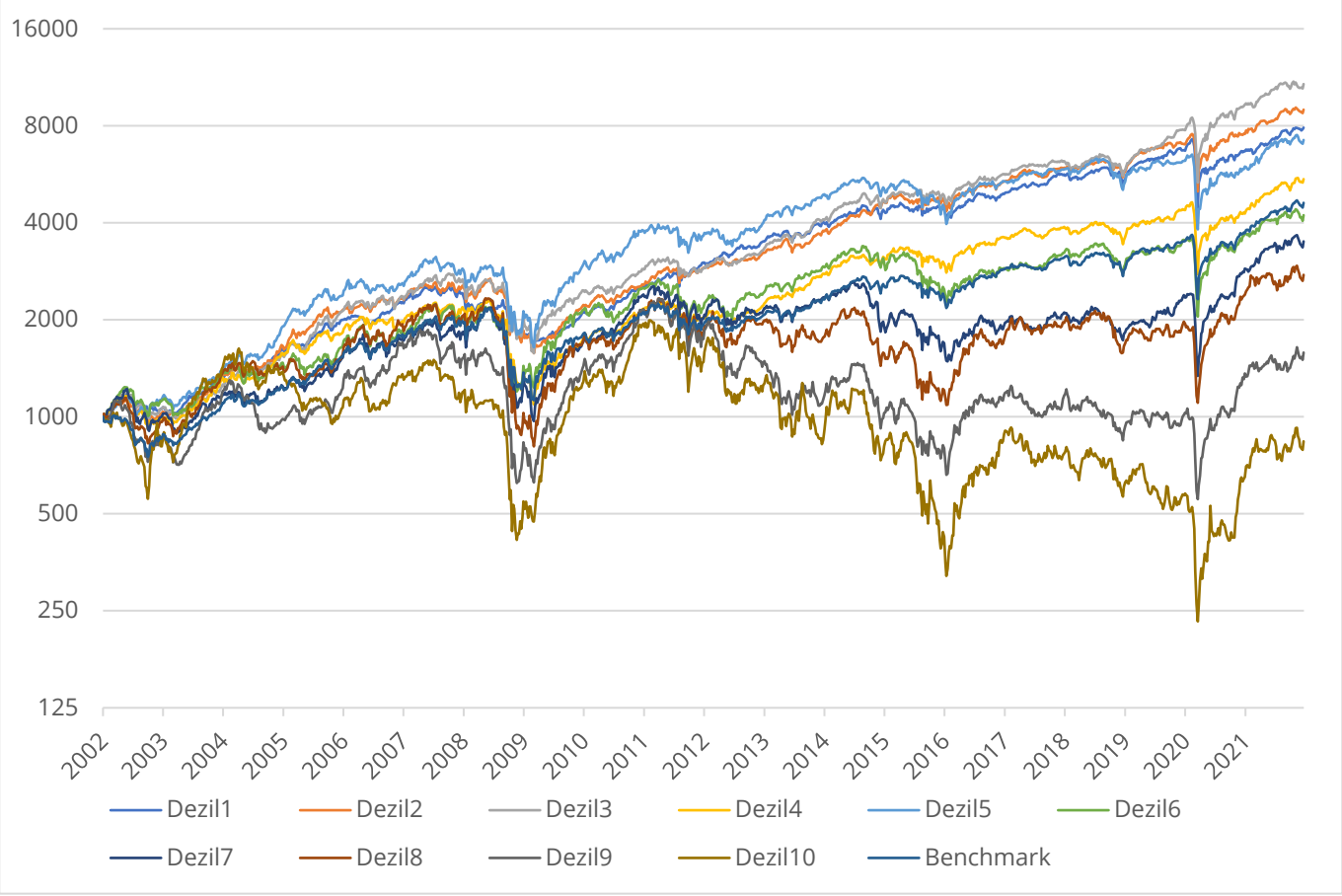
Safety-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Kanada
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	TSX Composite
Durchschnittliche Anzahl Aktien	234	Scoring-Modell:	Safety-Score

Dezilanalyse

	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	7,9%	10,9%	11,6%	12,6%	8,9%	10,4%	7,5%	6,5%	5,2%	2,3%	-0,9%
Annualisierte Volatilität	17,5%	13,0%	14,0%	15,7%	17,2%	17,8%	20,0%	22,2%	24,7%	27,4%	36,7%
Maximaler Drawdown	48,1%	38,6%	41,3%	43,3%	52,3%	47,5%	47,8%	55,7%	65,3%	76,1%	88,4%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,453	0,836	0,828	0,801	0,515	0,583	0,373	0,292	0,210	0,084	-0,024
Max 3 Jahre rollierend	100,8%	101,1%	121,8%	130,3%	106,0%	148,4%	89,9%	134,7%	152,1%	199,6%	271,4%
Min 3 Jahre rollierend	-31,0%	-19,6%	-27,7%	-29,5%	-44,3%	-34,8%	-29,5%	-40,0%	-52,5%	-54,6%	-76,2%
Max 5 Jahre rollierend	169,2%	145,0%	170,6%	181,5%	168,0%	209,8%	149,0%	147,1%	149,6%	126,3%	154,6%
Min 5 Jahre rollierend	-12,5%	-0,4%	3,2%	8,2%	-17,4%	-26,7%	-34,1%	-40,8%	-49,3%	-68,0%	-83,0%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	60,1%	64,5%	72,6%	52,0%	51,2%	38,3%	35,5%	44,0%	36,3%	34,3%

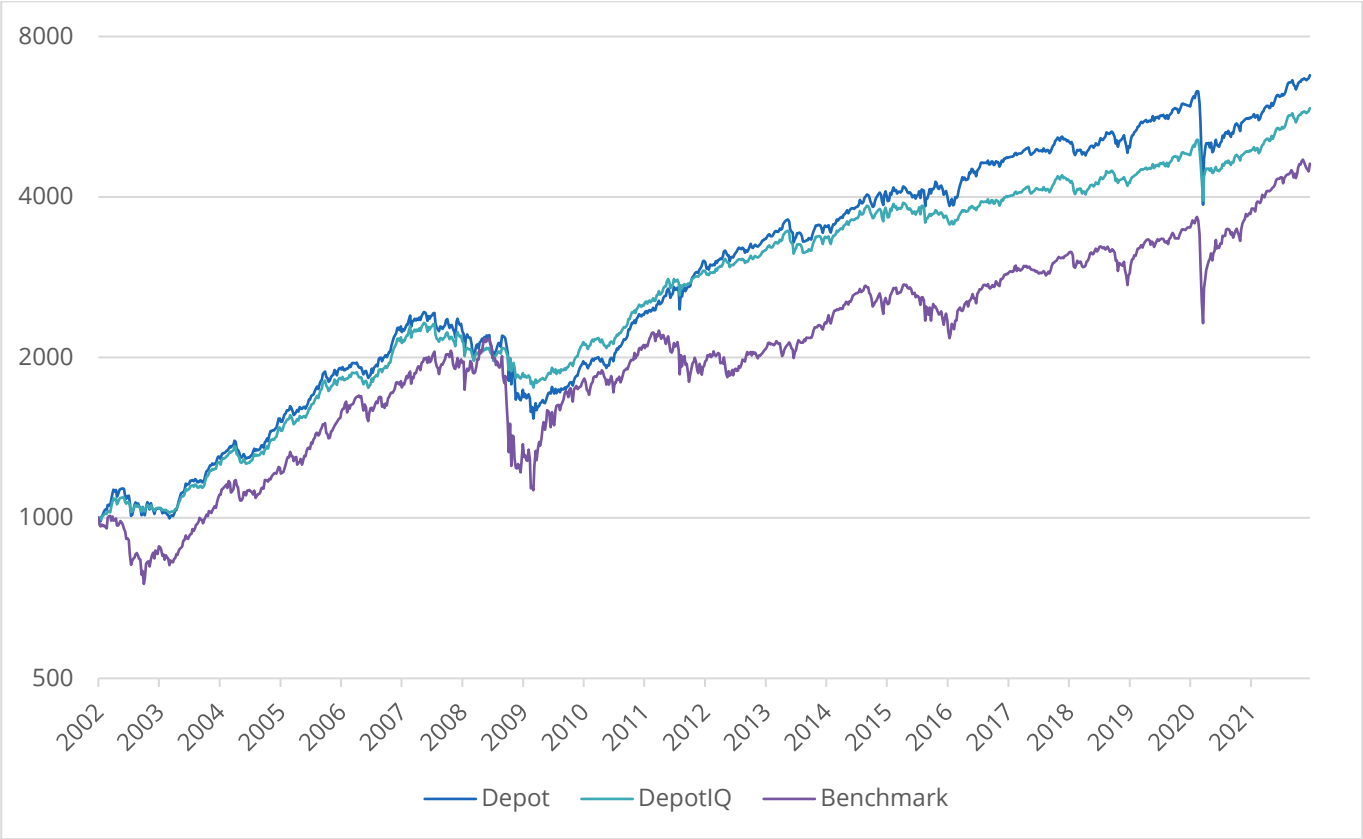


Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	10,0%	9,2%	7,9%
Annualisierte Volatilität	13,9%	9,4%	17,5%
Maximaler Drawdown	38,8%	24,3%	48,1%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,721	0,978	0,453

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Safety	80%
Verkaufskriterium 2	Safety	80%
Depotumschlagsfaktor	0,52	

Max 3 Jahre rollierend	94,2%	82,5%	100,8%
Min 3 Jahre rollierend	-21,3%	-10,1%	-31,0%
Max 5 Jahre rollierend	139,7%	125,0%	169,2%
Min 5 Jahre rollierend	-5,1%	3,6%	-12,5%
Anteil Outperformance 1 Jahr	52,0%	47,2%	---



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	18,6%	18,8%	-3,1%
30.12.2002	bis	29.12.2003	-2,2%	0,9%	29,7%
29.12.2003	bis	27.12.2004	3,5%	8,9%	-24,0%
27.12.2004	bis	26.12.2005	1,0%	1,7%	-22,8%
26.12.2005	bis	25.12.2006	2,2%	-4,4%	16,0%
25.12.2006	bis	31.12.2007	-8,9%	-3,1%	-21,2%
31.12.2007	bis	29.12.2008	8,4%	7,1%	-19,4%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-25,0%	-19,1%	84,2%
28.12.2009	bis	27.12.2010	7,0%	1,6%	34,4%
27.12.2010	bis	26.12.2011	34,4%	23,7%	-12,2%
26.12.2011	bis	31.12.2012	2,4%	6,5%	-22,9%
31.12.2012	bis	30.12.2013	-6,6%	3,5%	-40,6%
30.12.2013	bis	29.12.2014	4,8%	5,1%	-21,8%
29.12.2014	bis	28.12.2015	6,7%	8,5%	-23,8%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-3,0%	-7,3%	45,7%
26.12.2016	bis	25.12.2017	-1,3%	3,8%	-12,7%
25.12.2017	bis	31.12.2018	6,3%	5,1%	-12,0%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-4,0%	0,2%	-19,6%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-11,3%	-2,8%	14,5%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-3,7%	-5,3%	1,7%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002 bis 27.12.2004	7,7%	17,7%	18,8%	16,1%	16,5%	23,8%	13,8%	7,9%	12,5%	-0,8%	11,3%
27.12.2004 bis 28.12.2009	7,5%	5,3%	5,7%	9,6%	1,9%	9,2%	7,8%	6,1%	3,6%	7,7%	-1,6%
28.12.2009 bis 29.12.2014	7,6%	15,7%	16,1%	13,9%	12,6%	11,9%	7,7%	3,1%	-1,4%	-6,8%	-9,5%
29.12.2014 bis 30.12.2019	6,3%	8,9%	8,5%	10,4%	7,0%	3,9%	2,7%	3,8%	4,5%	0,5%	-5,8%
30.12.2019 bis 27.12.2021	14,8%	8,4%	13,1%	17,8%	11,6%	7,7%	9,1%	21,2%	18,1%	24,8%	21,2%

Annualisierte Volatilität	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002 bis 27.12.2004	13,5%	9,6%	11,2%	10,7%	12,9%	12,4%	14,2%	16,1%	16,6%	19,8%	28,3%
27.12.2004 bis 28.12.2009	24,0%	14,3%	17,9%	20,8%	23,8%	23,2%	26,1%	27,6%	29,8%	30,3%	34,5%
28.12.2009 bis 29.12.2014	13,8%	9,6%	9,6%	10,7%	12,0%	14,0%	16,8%	19,0%	22,9%	28,5%	35,4%
29.12.2014 bis 30.12.2019	11,9%	9,1%	10,0%	10,2%	11,5%	13,4%	14,8%	18,7%	22,6%	24,9%	38,0%
30.12.2019 bis 27.12.2021	23,0%	24,5%	22,3%	26,3%	24,5%	25,8%	27,2%	29,1%	30,1%	32,5%	50,8%

Maximaler Drawdown	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002 bis 27.12.2004	25,5%	13,9%	15,0%	17,6%	21,2%	12,5%	18,8%	26,8%	27,7%	36,7%	46,1%
27.12.2004 bis 28.12.2009	48,1%	35,0%	41,3%	43,3%	52,3%	47,5%	47,8%	55,7%	65,3%	66,5%	72,4%
28.12.2009 bis 29.12.2014	19,8%	9,6%	10,7%	12,7%	17,3%	18,4%	25,4%	29,9%	38,2%	60,4%	63,2%
29.12.2014 bis 30.12.2019	20,7%	11,3%	12,1%	14,4%	16,5%	27,0%	29,8%	30,7%	36,4%	41,9%	64,2%
30.12.2019 bis 27.12.2021	36,9%	38,6%	33,6%	37,2%	40,3%	41,5%	43,1%	44,5%	44,0%	47,8%	59,9%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum	Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002 bis 27.12.2004	15,5%	14,0%	7,7%	10,1%	7,2%	13,5%	12,2%	7,4%	25,5%
27.12.2004 bis 28.12.2009	4,8%	7,4%	7,5%	16,2%	10,8%	24,0%	36,9%	24,3%	48,1%
28.12.2009 bis 29.12.2014	16,0%	12,5%	7,6%	10,0%	8,3%	13,8%	9,4%	9,4%	19,8%
29.12.2014 bis 30.12.2019	7,6%	4,7%	6,3%	9,5%	7,8%	11,9%	10,0%	9,0%	20,7%
30.12.2019 bis 27.12.2021	6,8%	10,6%	14,8%	25,5%	14,2%	23,0%	38,8%	23,1%	36,9%

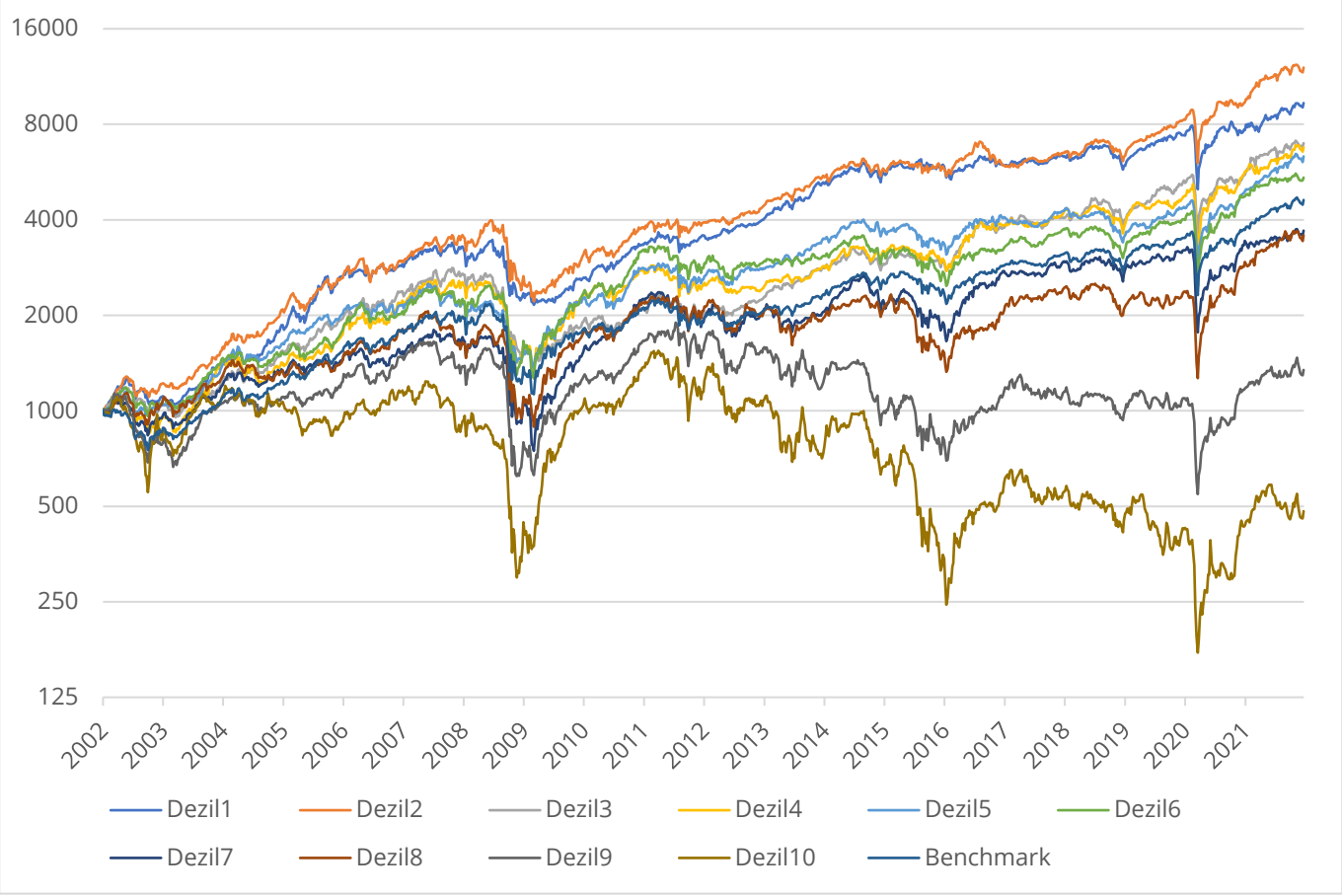
Technischer Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Kanada
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	TSX Composite
Durchschnittliche Anzahl Aktien	234	Scoring-Modell:	Technischer Score

Dezilanalyse

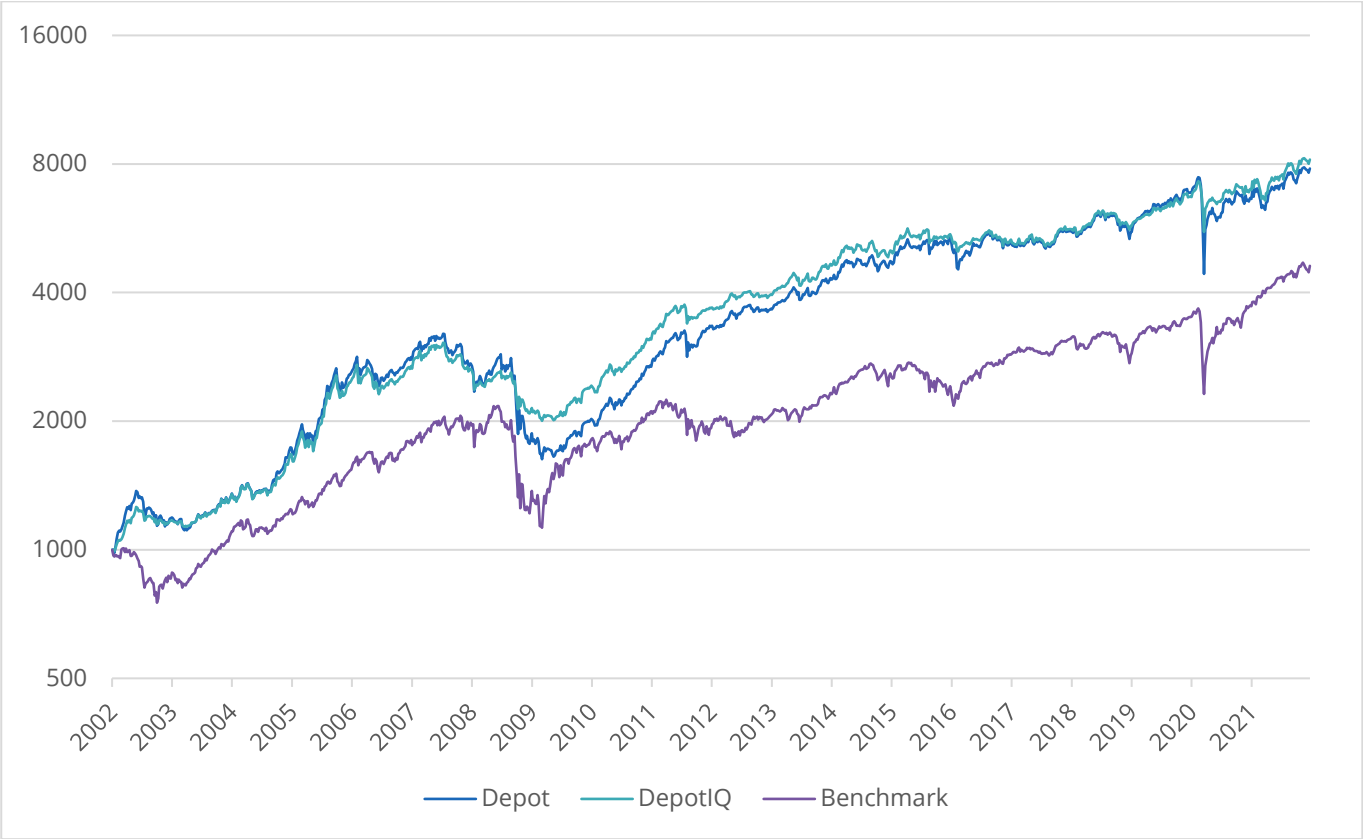
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	7,9%	11,8%	13,2%	10,2%	10,0%	9,7%	8,8%	6,8%	6,6%	1,5%	-3,6%
Annualisierte Volatilität	17,5%	15,4%	16,7%	17,8%	18,5%	16,8%	19,3%	20,9%	22,1%	25,8%	36,1%
Maximaler Drawdown	48,1%	37,7%	44,6%	52,6%	48,0%	46,0%	49,1%	58,5%	56,8%	71,2%	88,8%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,453	0,765	0,795	0,572	0,541	0,576	0,457	0,323	0,297	0,058	-0,099
Max 3 Jahre rollierend	100,8%	170,8%	150,8%	123,6%	125,5%	119,8%	136,6%	187,2%	146,7%	179,7%	286,3%
Min 3 Jahre rollierend	-31,0%	-21,0%	-22,0%	-35,9%	-28,7%	-36,5%	-36,5%	-50,9%	-42,8%	-57,1%	-78,1%
Max 5 Jahre rollierend	169,2%	218,3%	218,6%	191,9%	196,0%	160,5%	153,9%	201,7%	137,7%	125,6%	156,5%
Min 5 Jahre rollierend	-12,5%	-16,4%	-0,3%	-25,2%	-7,6%	-24,1%	-21,9%	-40,9%	-39,3%	-58,8%	-82,5%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	60,9%	74,2%	64,5%	53,6%	61,7%	47,6%	34,7%	44,4%	35,5%	30,2%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	10,8%	11,1%	7,9%
Annualisierte Volatilität	17,4%	12,7%	17,5%
Maximaler Drawdown	49,1%	34,4%	48,1%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,620	0,869	0,453
Max 3 Jahre rollierend	148,2%	135,6%	100,8%
Min 3 Jahre rollierend	-38,6%	-22,6%	-31,0%
Max 5 Jahre rollierend	195,8%	179,5%	169,2%
Min 5 Jahre rollierend	-14,3%	1,3%	-12,5%
Anteil Outperformance 1 Jahr	54,4%	53,2%	---

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Technisch	70%
Verkaufskriterium 2	Technisch	70%
Depotumschlagsfaktor	1,48	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	33,0%	30,5%	-6,2%
30.12.2002	bis	29.12.2003	-15,3%	0,9%	8,7%
29.12.2003	bis	27.12.2004	16,5%	18,1%	-14,2%
27.12.2004	bis	26.12.2005	24,7%	10,4%	-24,3%
26.12.2005	bis	25.12.2006	-7,5%	-5,1%	7,0%
25.12.2006	bis	31.12.2007	-13,6%	6,6%	-24,5%
31.12.2007	bis	29.12.2008	1,9%	6,2%	-18,0%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-29,2%	-23,4%	84,6%
28.12.2009	bis	27.12.2010	17,3%	8,7%	14,9%
27.12.2010	bis	26.12.2011	32,4%	13,5%	-2,8%
26.12.2011	bis	31.12.2012	2,1%	4,8%	-9,8%
31.12.2012	bis	30.12.2013	5,2%	15,4%	-39,6%
30.12.2013	bis	29.12.2014	-1,5%	-4,7%	-25,4%
29.12.2014	bis	28.12.2015	20,1%	10,2%	-25,2%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-21,4%	-18,3%	27,7%
26.12.2016	bis	25.12.2017	-2,0%	-0,7%	-7,8%
25.12.2017	bis	31.12.2018	8,0%	3,8%	-7,6%
31.12.2018	bis	30.12.2019	0,6%	4,8%	-20,1%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-9,4%	2,0%	-2,5%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-6,6%	1,6%	-10,0%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002 bis 27.12.2004	7,7%	23,2%	27,8%	15,7%	12,5%	17,6%	15,3%	10,6%	10,1%	3,3%	1,9%
27.12.2004 bis 28.12.2009	7,5%	7,0%	8,1%	4,2%	10,0%	6,7%	8,7%	2,3%	5,5%	2,7%	-0,6%
28.12.2009 bis 29.12.2014	7,6%	16,5%	13,5%	8,9%	6,8%	10,8%	6,2%	8,1%	3,7%	-4,8%	-8,3%
29.12.2014 bis 30.12.2019	6,3%	5,6%	7,3%	12,8%	8,2%	3,2%	5,0%	7,5%	2,7%	2,2%	-8,6%
30.12.2019 bis 27.12.2021	14,8%	12,4%	20,7%	14,5%	19,6%	20,1%	16,3%	7,4%	22,6%	10,7%	6,8%

Annualisierte Volatilität	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002 bis 27.12.2004	13,5%	13,4%	12,0%	13,4%	16,1%	13,3%	13,2%	13,4%	14,9%	17,8%	27,3%
27.12.2004 bis 28.12.2009	24,0%	18,9%	22,9%	23,6%	23,3%	20,7%	25,6%	26,9%	25,5%	28,3%	35,9%
28.12.2009 bis 29.12.2014	13,8%	11,3%	12,9%	14,6%	14,2%	14,5%	15,5%	17,6%	19,4%	24,8%	32,4%
29.12.2014 bis 30.12.2019	11,9%	10,7%	11,1%	12,3%	13,4%	12,6%	13,5%	17,0%	19,8%	25,2%	38,6%
30.12.2019 bis 27.12.2021	23,0%	24,7%	23,0%	24,8%	27,3%	23,4%	27,8%	28,3%	31,9%	32,7%	48,6%

Maximaler Drawdown	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002 bis 27.12.2004	25,5%	17,6%	13,7%	19,6%	24,0%	16,1%	18,9%	22,4%	20,5%	41,3%	50,0%
27.12.2004 bis 28.12.2009	48,1%	37,7%	44,6%	52,6%	48,0%	46,0%	49,1%	58,5%	56,8%	62,3%	75,9%
28.12.2009 bis 29.12.2014	19,8%	13,4%	12,1%	18,7%	20,1%	18,9%	22,1%	27,5%	29,8%	52,6%	59,3%
29.12.2014 bis 30.12.2019	20,7%	16,3%	17,1%	17,5%	18,3%	22,2%	24,4%	31,3%	43,1%	37,7%	68,5%
30.12.2019 bis 27.12.2021	36,9%	37,1%	32,1%	36,3%	40,8%	38,4%	42,1%	46,1%	46,8%	50,2%	59,6%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum	Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002 bis 27.12.2004	20,4%	18,9%	7,7%	13,9%	10,4%	13,5%	19,2%	10,2%	25,5%
27.12.2004 bis 28.12.2009	3,0%	7,5%	7,5%	21,2%	16,0%	24,0%	49,1%	34,4%	48,1%
28.12.2009 bis 29.12.2014	18,6%	15,8%	7,6%	11,8%	9,9%	13,8%	13,3%	9,6%	19,8%
29.12.2014 bis 30.12.2019	7,7%	5,9%	6,3%	11,6%	9,4%	11,9%	15,7%	11,7%	20,7%
30.12.2019 bis 27.12.2021	6,6%	10,6%	14,8%	30,8%	18,9%	23,0%	40,6%	23,9%	36,9%

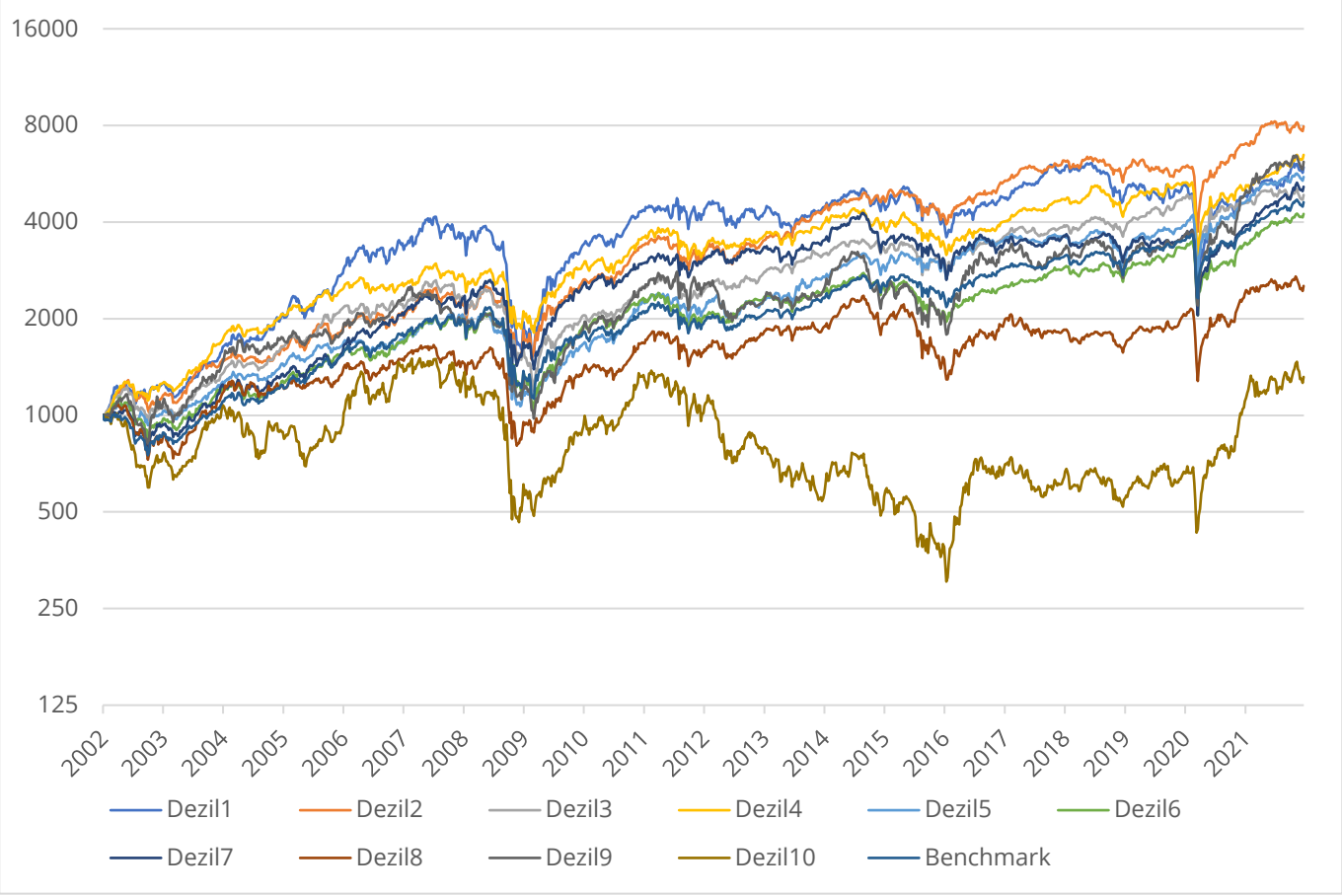
Value-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Kanada
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	TSX Composite
Durchschnittliche Anzahl Aktien	231	Scoring-Modell:	Value-Score

Dezilanalyse

	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	7,9%	9,3%	10,9%	8,2%	9,8%	8,9%	7,5%	8,5%	4,7%	9,5%	1,4%
Annualisierte Volatilität	17,5%	23,5%	17,9%	17,0%	17,0%	17,1%	18,0%	19,2%	20,3%	23,4%	31,5%
Maximaler Drawdown	48,1%	63,4%	41,6%	54,8%	44,1%	51,1%	51,3%	52,1%	51,4%	61,2%	79,9%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,453	0,396	0,609	0,482	0,576	0,520	0,416	0,445	0,234	0,406	0,044
Max 3 Jahre rollierend	100,8%	205,2%	125,8%	118,0%	120,4%	121,9%	104,7%	129,0%	95,1%	159,4%	166,3%
Min 3 Jahre rollierend	-31,0%	-53,0%	-33,9%	-43,4%	-30,7%	-40,7%	-34,7%	-40,7%	-38,0%	-50,0%	-61,6%
Max 5 Jahre rollierend	169,2%	283,5%	201,3%	178,3%	162,8%	178,1%	149,4%	196,2%	130,1%	191,3%	276,2%
Min 5 Jahre rollierend	-12,5%	-48,8%	-23,9%	-16,0%	-24,7%	-23,7%	-19,2%	-41,9%	-38,5%	-37,7%	-75,1%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	49,6%	57,7%	52,8%	45,6%	52,4%	39,1%	48,4%	39,1%	50,0%	38,7%

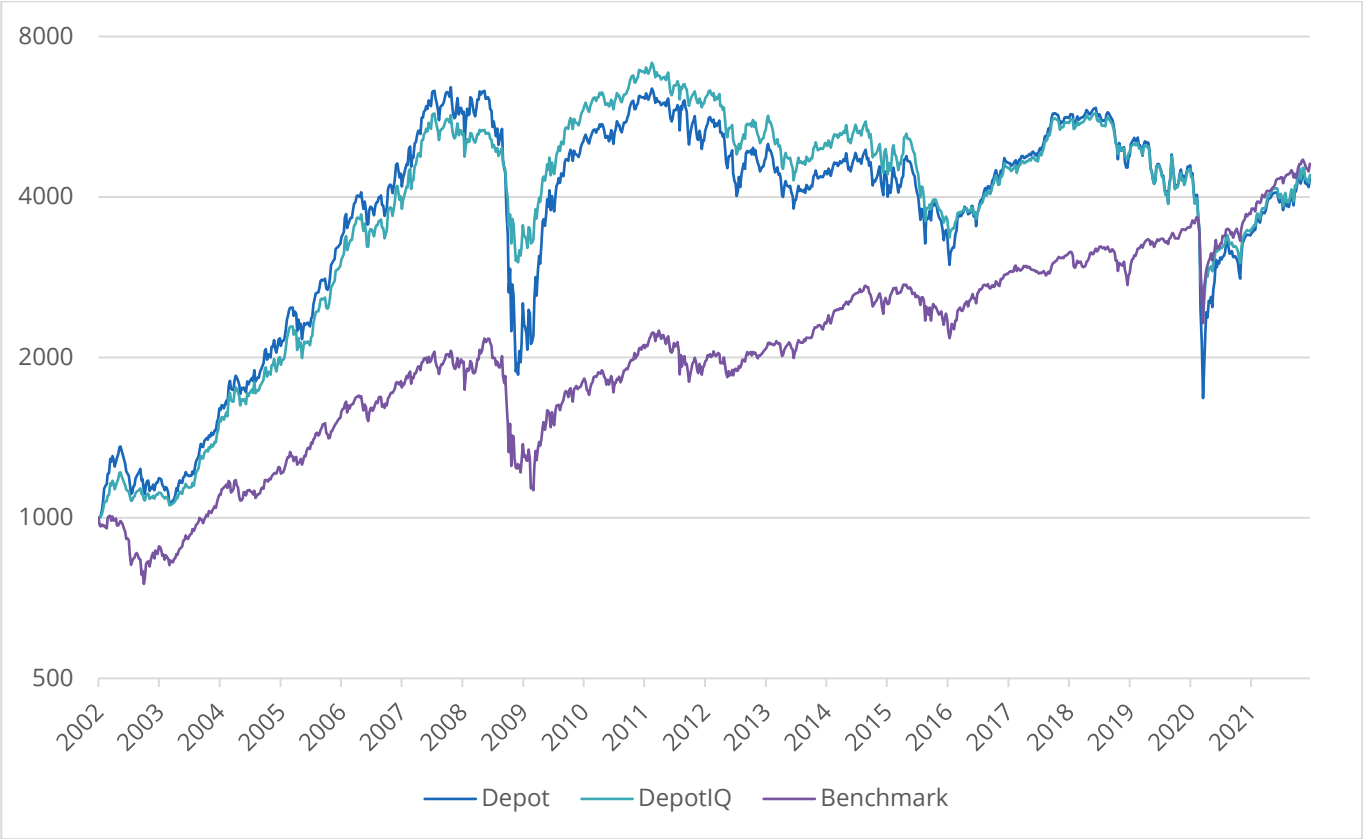


Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	7,6%	7,7%	7,9%
Annualisierte Volatilität	27,6%	19,7%	17,5%
Maximaler Drawdown	73,9%	66,9%	48,1%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,275	0,390	0,453

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Value	90%
Verkaufskriterium 2	Value	90%
Depotumschlagsfaktor	0,91	

Max 3 Jahre rollierend	264,5%	239,4%	100,8%
Min 3 Jahre rollierend	-64,9%	-49,3%	-31,0%
Max 5 Jahre rollierend	475,0%	432,5%	169,2%
Min 5 Jahre rollierend	-59,9%	-51,2%	-12,5%
Anteil Outperformance 1 Jahr	46,8%	48,0%	---



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	30,8%	33,4%	3,0%
30.12.2002	bis	29.12.2003	4,2%	1,2%	13,9%
29.12.2003	bis	27.12.2004	26,9%	6,1%	-11,0%
27.12.2004	bis	26.12.2005	26,8%	-0,1%	-20,7%
26.12.2005	bis	25.12.2006	18,3%	2,4%	24,8%
25.12.2006	bis	31.12.2007	23,6%	-3,0%	-22,4%
31.12.2007	bis	29.12.2008	-28,3%	-4,9%	-13,6%
29.12.2008	bis	28.12.2009	96,9%	38,1%	20,7%
28.12.2009	bis	27.12.2010	5,2%	12,1%	24,0%
27.12.2010	bis	26.12.2011	-8,6%	3,1%	-3,1%
26.12.2011	bis	31.12.2012	-15,9%	-1,1%	-23,0%
31.12.2012	bis	30.12.2013	-17,2%	1,9%	-24,0%
30.12.2013	bis	29.12.2014	-11,2%	-3,4%	-17,4%
29.12.2014	bis	28.12.2015	-15,8%	-5,5%	-9,4%
28.12.2015	bis	26.12.2016	15,3%	2,1%	39,3%
26.12.2016	bis	25.12.2017	13,1%	11,1%	-9,2%
25.12.2017	bis	31.12.2018	-7,7%	-5,1%	-4,1%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-26,8%	-15,8%	1,1%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-32,1%	-1,8%	39,6%
28.12.2020	bis	27.12.2021	3,6%	-5,1%	2,5%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	7,7%	27,3%	18,0%	17,9%	27,7%	13,2%	8,5%	10,4%	7,5%	20,7%	-3,8%
27.12.2004	bis	28.12.2009	7,5%	10,5%	9,8%	4,5%	7,2%	2,8%	8,1%	13,5%	1,8%	1,0%	0,3%
28.12.2009	bis	29.12.2014	7,6%	6,6%	13,0%	10,4%	6,4%	12,1%	6,2%	6,5%	7,3%	4,8%	-10,8%
29.12.2014	bis	30.12.2019	6,3%	2,3%	4,3%	7,3%	5,8%	5,8%	5,3%	0,8%	1,4%	9,1%	5,6%
30.12.2019	bis	27.12.2021	14,8%	6,6%	15,6%	0,9%	10,5%	18,7%	13,1%	19,4%	10,6%	30,7%	40,6%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	13,5%	13,8%	12,4%	11,8%	12,4%	11,4%	14,9%	14,7%	18,2%	20,1%	24,6%
27.12.2004	bis	28.12.2009	24,0%	31,4%	24,4%	21,0%	19,8%	21,5%	22,5%	22,9%	22,7%	25,1%	36,4%
28.12.2009	bis	29.12.2014	13,8%	18,1%	13,7%	12,4%	14,1%	15,3%	14,4%	16,0%	17,3%	21,3%	29,3%
29.12.2014	bis	30.12.2019	11,9%	16,7%	13,1%	12,9%	13,1%	12,9%	13,5%	15,2%	19,0%	22,3%	30,7%
30.12.2019	bis	27.12.2021	23,0%	35,5%	24,5%	28,3%	27,5%	24,4%	26,2%	28,8%	26,2%	30,3%	34,3%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	25,5%	14,4%	20,7%	21,4%	12,7%	14,0%	25,1%	24,8%	33,1%	29,8%	41,3%
27.12.2004	bis	28.12.2009	48,1%	63,4%	41,0%	54,8%	39,1%	51,1%	51,3%	47,4%	51,4%	61,2%	69,2%
28.12.2009	bis	29.12.2014	19,8%	22,5%	21,4%	18,6%	20,1%	18,9%	23,5%	24,7%	24,4%	33,5%	64,6%
29.12.2014	bis	30.12.2019	20,7%	30,6%	21,9%	21,1%	26,2%	22,5%	25,4%	27,8%	41,8%	32,0%	48,9%
30.12.2019	bis	27.12.2021	36,9%	54,3%	38,0%	42,5%	44,1%	37,1%	41,2%	46,0%	40,6%	41,7%	37,9%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	29,5%	26,1%	7,7%	16,8%	13,7%	13,5%	21,9%	13,3%	25,5%
27.12.2004	bis	28.12.2009	18,4%	23,6%	7,5%	38,2%	24,9%	24,0%	71,1%	47,4%	48,1%
28.12.2009	bis	29.12.2014	-2,4%	-3,2%	7,6%	19,8%	16,3%	13,8%	40,5%	39,9%	19,8%
29.12.2014	bis	30.12.2019	0,4%	-1,8%	6,3%	20,4%	17,1%	11,9%	37,5%	36,1%	20,7%
30.12.2019	bis	27.12.2021	-2,7%	-1,1%	14,8%	38,7%	25,1%	23,0%	63,4%	47,6%	36,9%

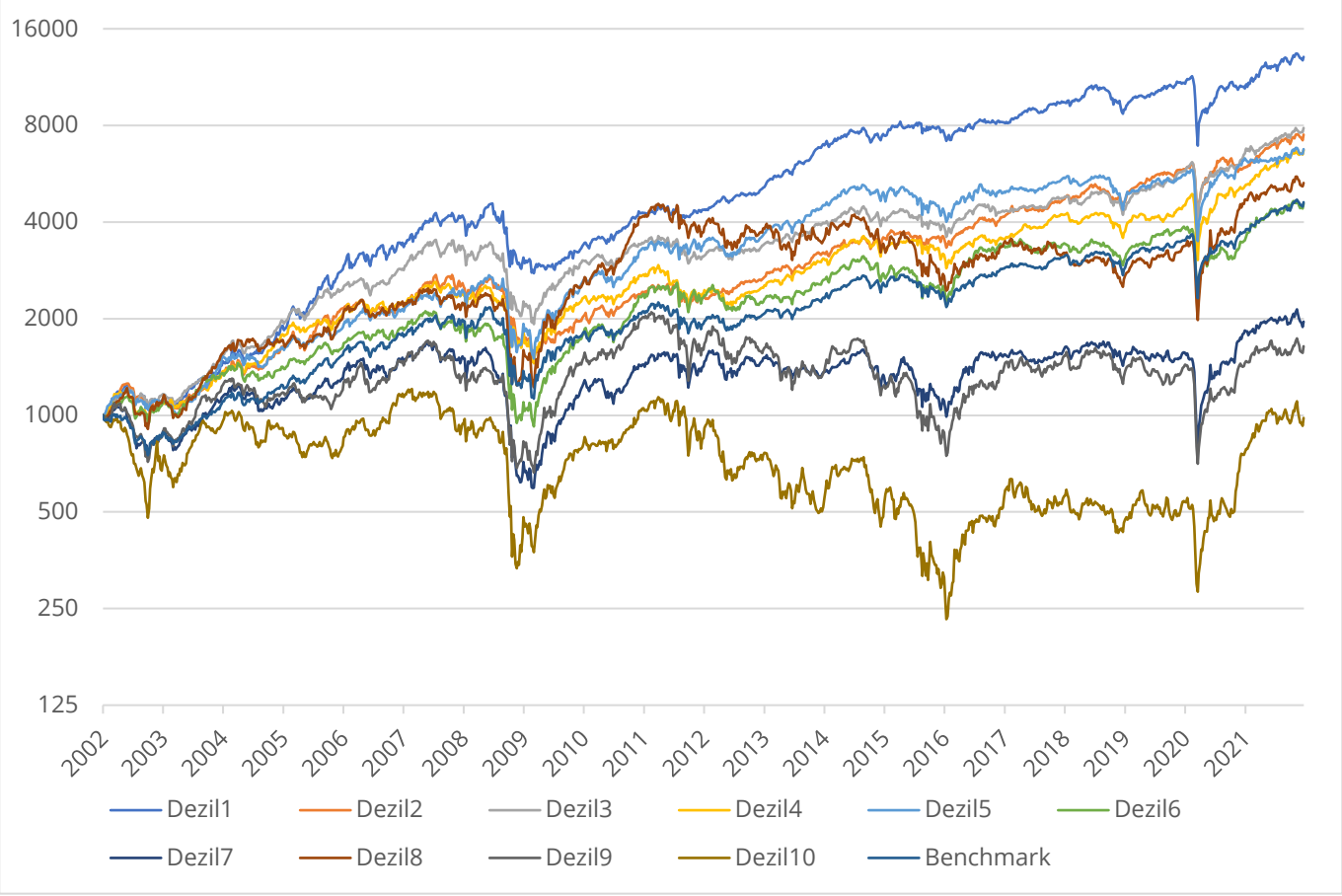
Kombi-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Kanada
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	TSX Composite
Durchschnittliche Anzahl Aktien	231	Scoring-Modell:	Kombi-Score

Dezilanalyse

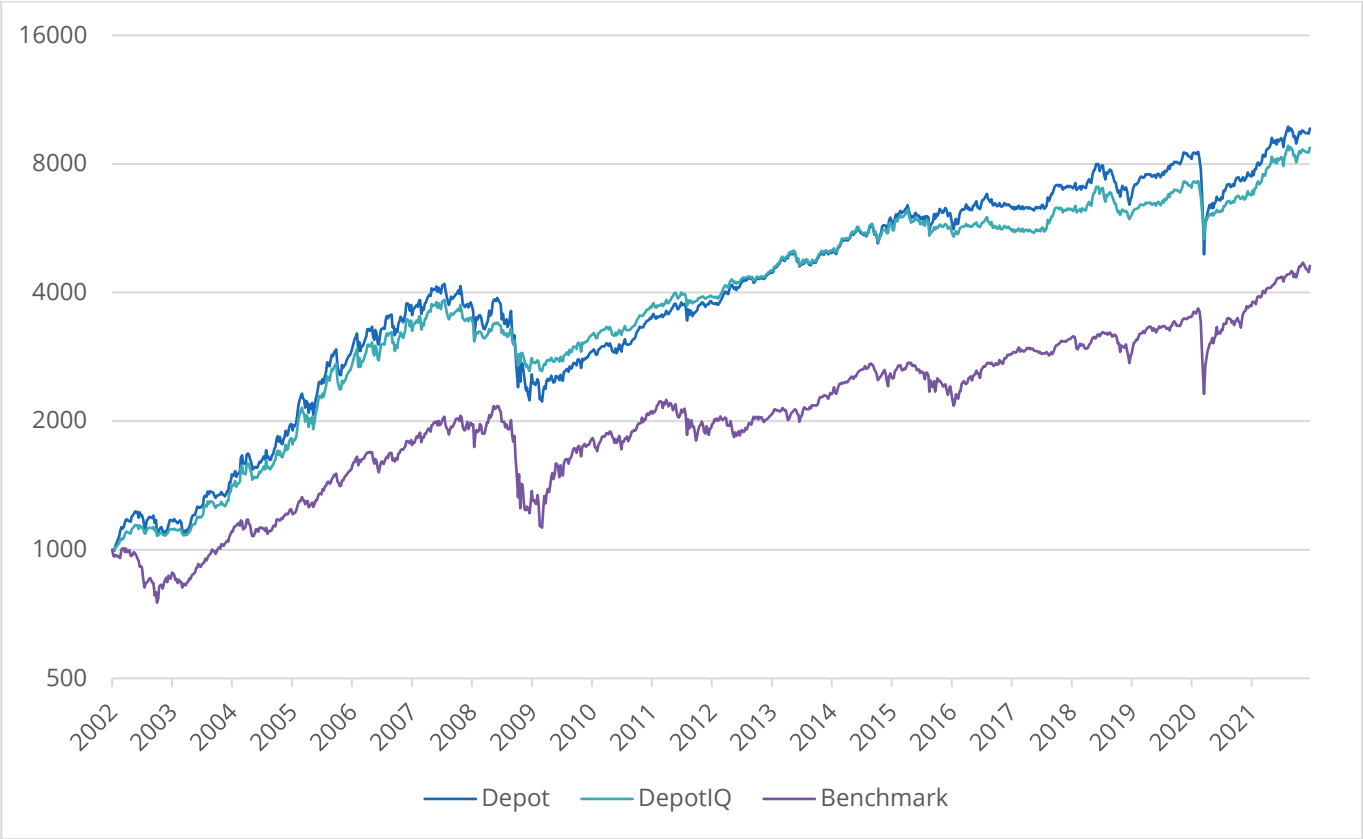
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	7,9%	13,7%	10,6%	10,8%	10,0%	10,0%	7,9%	3,4%	8,7%	2,5%	-0,1%
Annualisierte Volatilität	17,5%	16,1%	15,9%	15,9%	17,2%	18,1%	18,8%	22,4%	23,1%	25,3%	33,4%
Maximaler Drawdown	48,1%	39,4%	45,5%	45,3%	44,3%	45,0%	56,3%	64,9%	56,5%	66,4%	80,8%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,453	0,851	0,668	0,680	0,579	0,552	0,419	0,152	0,375	0,099	-0,003
Max 3 Jahre rollierend	100,8%	195,9%	113,1%	136,5%	109,8%	136,1%	169,1%	168,7%	225,7%	178,1%	169,1%
Min 3 Jahre rollierend	-31,0%	-18,4%	-32,4%	-26,0%	-33,0%	-30,8%	-47,7%	-58,6%	-42,8%	-55,3%	-69,6%
Max 5 Jahre rollierend	169,2%	304,0%	161,2%	227,6%	161,5%	214,4%	198,6%	138,6%	222,3%	145,0%	238,6%
Min 5 Jahre rollierend	-12,5%	-13,5%	-8,9%	-10,3%	-13,8%	-29,2%	-33,1%	-52,1%	-41,9%	-62,8%	-77,5%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	72,2%	67,3%	59,3%	51,6%	58,1%	40,3%	35,1%	41,1%	39,5%	36,3%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	12,0%	11,4%	7,9%
Annualisierte Volatilität	18,0%	13,8%	17,5%
Maximaler Drawdown	47,0%	32,0%	48,1%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,666	0,829	0,453
Max 3 Jahre rollierend	193,8%	176,3%	100,8%
Min 3 Jahre rollierend	-29,9%	-16,5%	-31,0%
Max 5 Jahre rollierend	275,1%	253,3%	169,2%
Min 5 Jahre rollierend	-21,7%	-13,0%	-12,5%
Anteil Outperformance 1 Jahr	61,3%	59,3%	---

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Kombi	70%
Verkaufskriterium 2	Kombi	70%
Depotumschlagsfaktor	1,13	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	31,8%	24,5%	-9,3%
30.12.2002	bis	29.12.2003	-4,5%	-1,4%	14,7%
29.12.2003	bis	27.12.2004	22,0%	12,7%	-18,2%
27.12.2004	bis	26.12.2005	22,1%	17,2%	-29,5%
26.12.2005	bis	25.12.2006	11,3%	-3,7%	18,7%
25.12.2006	bis	31.12.2007	-7,1%	8,0%	-25,3%
31.12.2007	bis	29.12.2008	-1,2%	4,8%	-13,4%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-19,5%	-25,7%	52,3%
28.12.2009	bis	27.12.2010	3,5%	6,6%	16,9%
27.12.2010	bis	26.12.2011	17,6%	7,3%	-11,2%
26.12.2011	bis	31.12.2012	9,7%	8,7%	-13,5%
31.12.2012	bis	30.12.2013	-1,3%	16,0%	-36,1%
30.12.2013	bis	29.12.2014	9,2%	-1,5%	-19,0%
29.12.2014	bis	28.12.2015	9,0%	8,4%	-23,3%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-15,1%	-8,5%	37,0%
26.12.2016	bis	25.12.2017	3,3%	5,8%	0,3%
25.12.2017	bis	31.12.2018	1,7%	4,7%	-5,8%
31.12.2018	bis	30.12.2019	2,2%	1,3%	-11,2%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-15,8%	-7,2%	13,4%
28.12.2020	bis	27.12.2021	4,7%	1,5%	-0,9%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	7,7%	23,8%	17,9%	25,7%	21,4%	17,8%	12,4%	4,1%	19,8%	5,5%	-3,0%
27.12.2004	bis	28.12.2009	7,5%	12,2%	4,3%	8,9%	5,4%	9,8%	4,6%	1,8%	8,4%	4,8%	-2,7%
28.12.2009	bis	29.12.2014	7,6%	17,4%	12,2%	6,3%	7,7%	13,7%	9,3%	1,7%	5,9%	-3,7%	-9,5%
29.12.2014	bis	30.12.2019	6,3%	7,6%	10,2%	6,9%	6,0%	2,6%	6,9%	3,3%	-0,3%	2,9%	2,3%
30.12.2019	bis	27.12.2021	14,8%	9,7%	13,2%	16,7%	22,0%	9,5%	8,5%	11,5%	25,5%	7,6%	34,7%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	13,5%	13,0%	11,7%	11,8%	11,9%	13,9%	14,8%	15,6%	16,6%	17,6%	27,7%
27.12.2004	bis	28.12.2009	24,0%	21,9%	20,2%	20,3%	23,1%	23,6%	22,7%	27,5%	26,7%	28,1%	34,3%
28.12.2009	bis	29.12.2014	13,8%	10,3%	12,8%	12,7%	14,0%	13,9%	16,5%	18,7%	21,4%	24,3%	30,8%
29.12.2014	bis	30.12.2019	11,9%	10,3%	10,4%	11,2%	11,9%	14,2%	14,5%	19,3%	18,8%	24,3%	35,9%
30.12.2019	bis	27.12.2021	23,0%	24,9%	24,9%	24,1%	24,2%	24,8%	26,5%	31,0%	33,8%	32,1%	38,2%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	25,5%	17,0%	17,4%	12,3%	18,1%	17,7%	17,0%	28,9%	25,5%	34,3%	52,1%
27.12.2004	bis	28.12.2009	48,1%	39,4%	45,5%	45,3%	44,3%	45,0%	56,3%	64,9%	50,8%	61,2%	72,4%
28.12.2009	bis	29.12.2014	19,8%	12,1%	15,4%	17,9%	25,7%	12,8%	19,1%	23,7%	33,1%	44,9%	60,5%
29.12.2014	bis	30.12.2019	20,7%	18,4%	15,3%	18,2%	18,9%	21,9%	22,2%	34,8%	34,6%	44,9%	61,1%
30.12.2019	bis	27.12.2021	36,9%	39,2%	36,5%	37,2%	37,8%	40,1%	42,5%	48,1%	43,4%	51,0%	49,0%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	25,5%	22,3%	7,7%	14,8%	12,3%	13,5%	11,3%	8,4%	25,5%
27.12.2004	bis	28.12.2009	8,1%	11,7%	7,5%	25,1%	19,2%	24,0%	47,0%	32,0%	48,1%
28.12.2009	bis	29.12.2014	15,6%	13,0%	7,6%	10,1%	8,6%	13,8%	9,4%	9,4%	19,8%
29.12.2014	bis	30.12.2019	6,7%	4,0%	6,3%	12,6%	10,6%	11,9%	19,7%	16,1%	20,7%
30.12.2019	bis	27.12.2021	7,9%	10,8%	14,8%	26,3%	16,9%	23,0%	42,4%	27,0%	36,9%

Hong Kong – HangSeng Composite

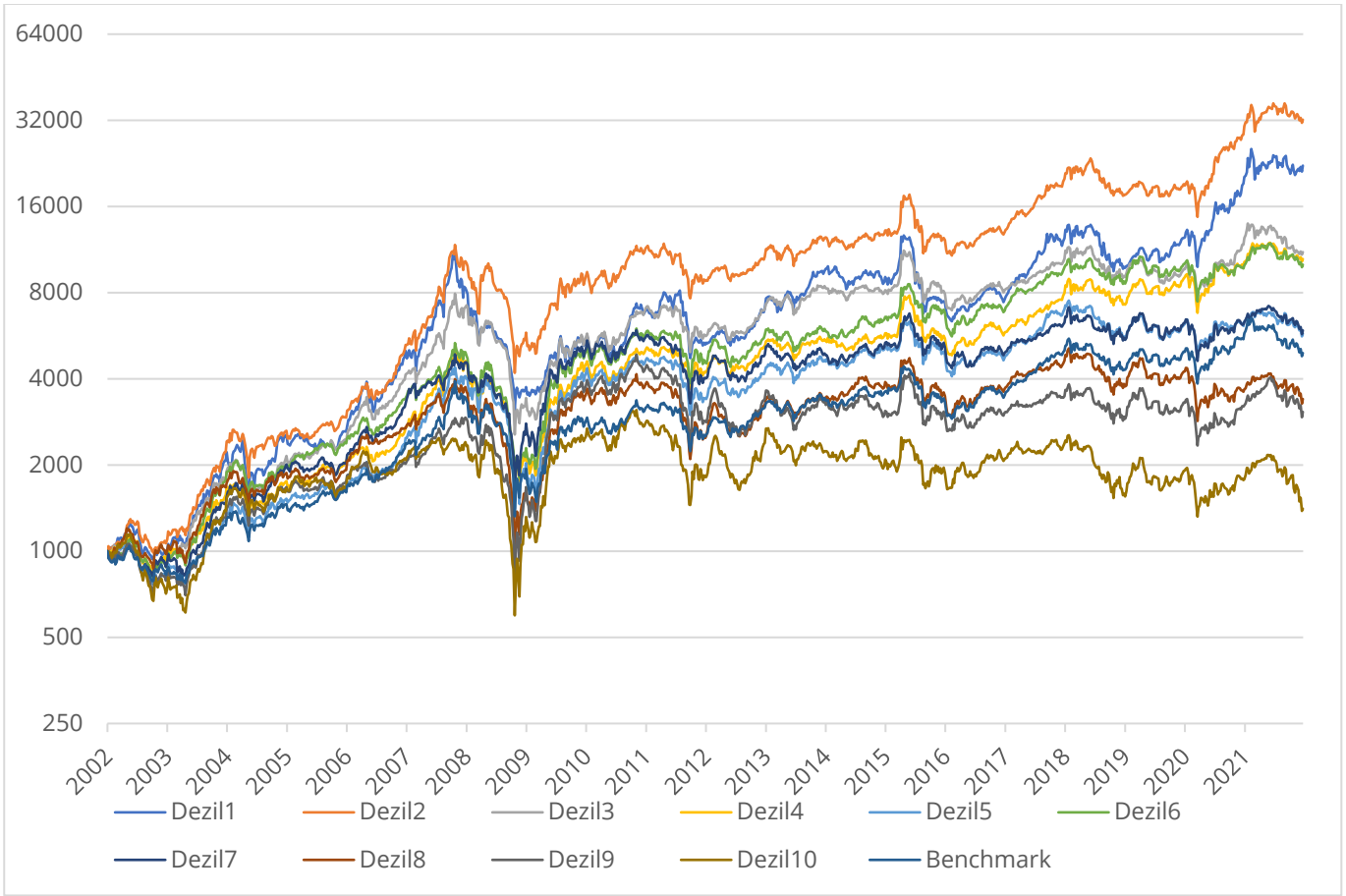
Trend-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Hong Kong
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	Hang Seng Comp
Durchschnittliche Anzahl Aktien	276	Scoring-Modell:	Trend-Score

Dezilanalyse

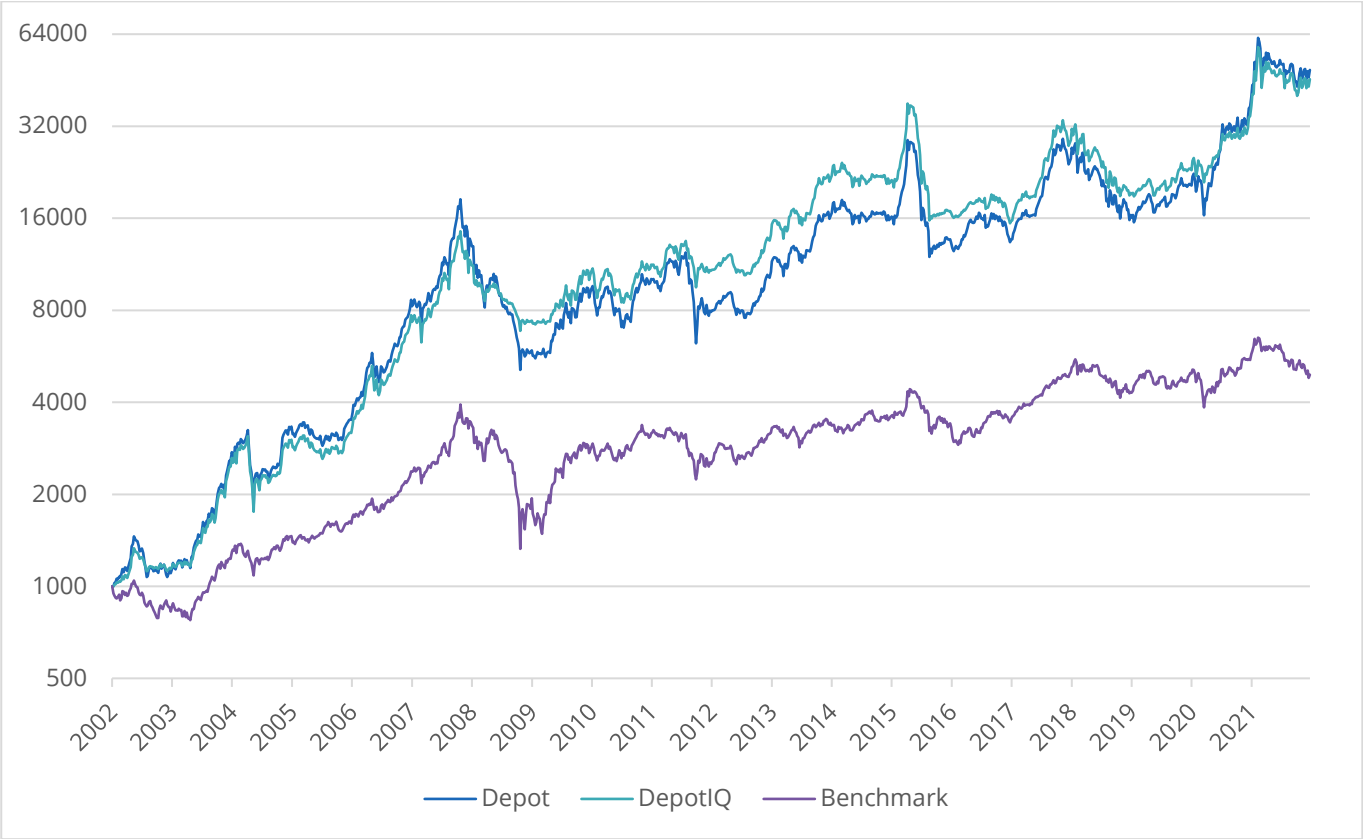
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	8,3%	16,7%	18,9%	12,8%	12,4%	9,1%	12,2%	9,3%	6,3%	5,8%	1,7%
Annualisierte Volatilität	23,6%	29,7%	26,8%	25,1%	25,6%	25,6%	25,5%	26,2%	26,8%	29,8%	31,8%
Maximaler Drawdown	66,3%	72,0%	64,3%	67,9%	69,7%	68,0%	69,7%	69,3%	76,1%	75,5%	76,1%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,351	0,564	0,707	0,509	0,487	0,357	0,478	0,354	0,235	0,193	0,054
Max 3 Jahre rollierend	194,9%	420,2%	400,4%	336,4%	220,6%	211,7%	220,2%	221,3%	171,6%	314,8%	261,8%
Min 3 Jahre rollierend	-18,4%	-39,1%	-7,2%	-16,5%	-18,0%	-13,3%	-25,5%	-19,0%	-45,4%	-54,3%	-60,6%
Max 5 Jahre rollierend	361,2%	1044,7%	1053,7%	805,7%	469,8%	453,3%	499,0%	440,5%	326,1%	350,1%	305,5%
Min 5 Jahre rollierend	-23,9%	-44,6%	-16,0%	-23,9%	-6,9%	-16,8%	-6,2%	-24,4%	-43,0%	-45,3%	-53,4%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	65,3%	74,6%	58,5%	62,9%	45,6%	59,7%	46,0%	33,5%	28,6%	29,8%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	21,4%	21,0%	8,3%
Annualisierte Volatilität	34,1%	29,6%	23,6%
Maximaler Drawdown	72,3%	59,5%	66,3%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,628	0,708	0,351
Max 3 Jahre rollierend	603,8%	496,6%	194,9%
Min 3 Jahre rollierend	-47,6%	-34,4%	-18,4%
Max 5 Jahre rollierend	1517,9%	1152,8%	361,2%
Min 5 Jahre rollierend	-51,9%	-41,5%	-23,9%
Anteil Outperformance 1 Jahr	64,9%	68,6%	---

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Trend	70%
Verkaufskriterium 2	Trend	70%
Depotumschlagsfaktor	1,59	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	27,8%	19,6%	-7,7%
30.12.2002	bis	29.12.2003	84,6%	61,2%	31,4%
29.12.2003	bis	27.12.2004	8,7%	1,5%	3,1%
27.12.2004	bis	26.12.2005	-4,6%	-3,8%	-8,2%
26.12.2005	bis	25.12.2006	89,2%	36,9%	-18,1%
25.12.2006	bis	31.12.2007	15,9%	37,9%	-21,4%
31.12.2007	bis	29.12.2008	-8,4%	-3,6%	-1,8%
29.12.2008	bis	28.12.2009	0,1%	-2,0%	72,0%
28.12.2009	bis	27.12.2010	-3,0%	15,8%	2,5%
27.12.2010	bis	26.12.2011	-1,4%	-2,8%	-15,3%
26.12.2011	bis	31.12.2012	9,2%	0,9%	-0,3%
31.12.2012	bis	30.12.2013	44,1%	18,1%	-12,0%
30.12.2013	bis	29.12.2014	-6,2%	-7,1%	-15,6%
29.12.2014	bis	28.12.2015	-9,8%	-4,0%	5,6%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-2,7%	0,2%	0,4%
26.12.2016	bis	25.12.2017	38,6%	14,4%	-29,9%
25.12.2017	bis	31.12.2018	-20,1%	-1,6%	-10,1%
31.12.2018	bis	30.12.2019	10,6%	2,2%	0,8%
30.12.2019	bis	28.12.2020	69,3%	41,4%	-15,6%
28.12.2020	bis	27.12.2021	42,5%	24,7%	-1,9%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	13,4%	36,3%	38,1%	27,7%	20,4%	14,8%	25,5%	25,3%	23,1%	18,4%	17,2%
27.12.2004	bis	28.12.2009	14,0%	16,2%	27,5%	21,1%	20,4%	22,0%	19,8%	20,5%	13,2%	17,5%	9,0%
28.12.2009	bis	29.12.2014	5,0%	10,3%	7,7%	8,1%	5,0%	4,3%	5,7%	0,7%	1,5%	-4,3%	-4,4%
29.12.2014	bis	30.12.2019	6,8%	7,3%	8,3%	3,8%	9,7%	4,0%	9,3%	3,9%	2,6%	2,1%	-0,8%
30.12.2019	bis	27.12.2021	-0,6%	33,8%	29,6%	7,2%	8,2%	-3,4%	-0,2%	-2,8%	-10,4%	-3,7%	-14,1%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	19,8%	31,9%	25,8%	25,8%	22,9%	22,9%	23,6%	22,5%	22,8%	24,1%	28,3%
27.12.2004	bis	28.12.2009	33,0%	34,8%	35,3%	32,4%	36,3%	35,8%	35,3%	36,2%	35,5%	41,6%	41,6%
28.12.2009	bis	29.12.2014	18,2%	23,2%	20,3%	19,4%	18,8%	20,1%	20,4%	21,7%	23,5%	24,8%	28,4%
29.12.2014	bis	30.12.2019	19,0%	26,7%	22,3%	21,4%	20,7%	20,5%	19,8%	21,1%	21,6%	23,8%	26,1%
30.12.2019	bis	27.12.2021	23,3%	34,2%	27,8%	24,5%	22,5%	22,5%	23,1%	23,2%	26,5%	26,8%	30,1%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	25,7%	40,9%	32,0%	32,9%	28,5%	30,0%	28,1%	22,2%	27,7%	34,0%	46,8%
27.12.2004	bis	28.12.2009	66,3%	72,0%	64,3%	67,9%	69,7%	68,0%	69,7%	69,3%	76,1%	75,5%	76,1%
28.12.2009	bis	29.12.2014	33,6%	41,9%	35,6%	31,5%	28,5%	38,5%	35,5%	44,7%	49,5%	49,9%	53,5%
29.12.2014	bis	30.12.2019	34,3%	49,9%	38,8%	38,2%	38,1%	36,1%	34,3%	35,7%	38,0%	37,1%	39,8%
30.12.2019	bis	27.12.2021	26,3%	25,7%	24,9%	24,2%	26,8%	26,5%	28,2%	28,5%	34,8%	31,2%	36,3%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	48,8%	43,9%	13,4%	33,1%	30,2%	19,8%	43,4%	43,4%	25,7%
27.12.2004	bis	28.12.2009	22,8%	28,6%	14,0%	36,1%	29,4%	33,0%	72,3%	52,7%	66,3%
28.12.2009	bis	29.12.2014	11,7%	14,9%	5,0%	29,2%	23,7%	18,2%	49,6%	29,6%	33,6%
29.12.2014	bis	30.12.2019	5,2%	2,0%	6,8%	32,6%	30,7%	19,0%	58,5%	59,4%	34,3%
30.12.2019	bis	27.12.2021	54,0%	40,3%	-0,6%	44,0%	39,0%	23,3%	30,7%	30,7%	26,2%

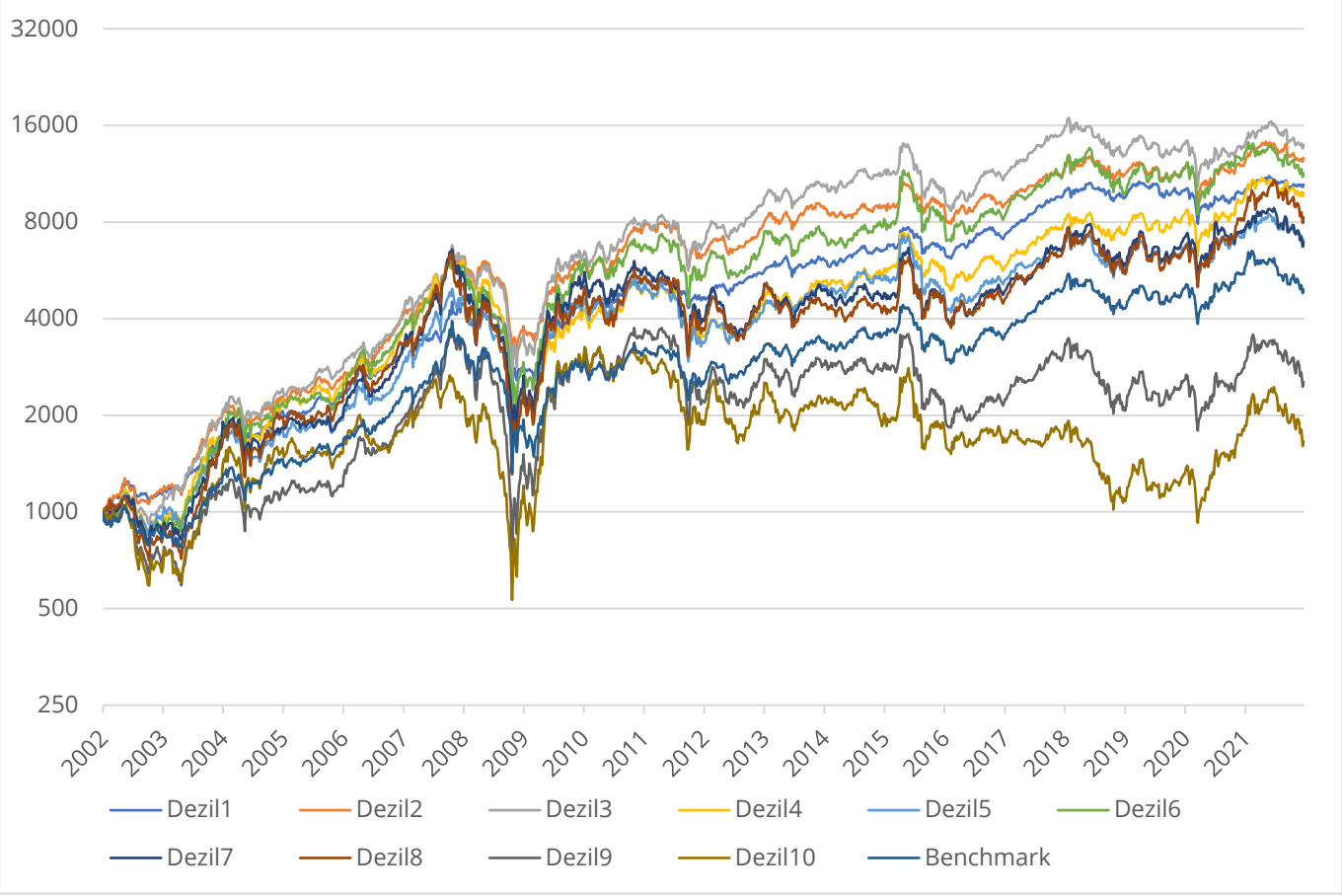
Safety-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Hong Kong
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	Hang Seng Comp
Durchschnittliche Anzahl Aktien	277	Scoring-Modell:	Safety-Score

Dezilanalyse

	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	8,3%	12,4%	13,5%	14,1%	12,1%	10,2%	12,9%	10,1%	11,1%	4,8%	2,6%
Annualisierte Volatilität	23,6%	16,4%	19,4%	22,5%	23,9%	25,8%	27,5%	30,7%	32,1%	34,4%	35,4%
Maximaler Drawdown	66,3%	48,0%	56,8%	62,9%	71,2%	69,7%	68,7%	76,3%	79,5%	82,2%	80,1%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,351	0,760	0,697	0,624	0,507	0,397	0,469	0,330	0,346	0,139	0,072
Max 3 Jahre rollierend	194,9%	144,1%	219,0%	211,7%	238,1%	208,4%	260,7%	285,2%	288,3%	258,2%	254,2%
Min 3 Jahre rollierend	-18,4%	-1,4%	-7,4%	-15,1%	-26,0%	-18,5%	-13,7%	-26,1%	-31,9%	-41,2%	-61,2%
Max 5 Jahre rollierend	361,2%	309,4%	502,2%	593,6%	584,8%	451,4%	649,0%	670,0%	741,4%	436,5%	333,1%
Min 5 Jahre rollierend	-23,9%	13,5%	-1,8%	-15,3%	-38,2%	-22,4%	-15,1%	-39,3%	-39,3%	-50,0%	-60,7%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	55,7%	63,7%	68,6%	66,5%	54,0%	58,5%	51,6%	56,5%	44,4%	30,2%

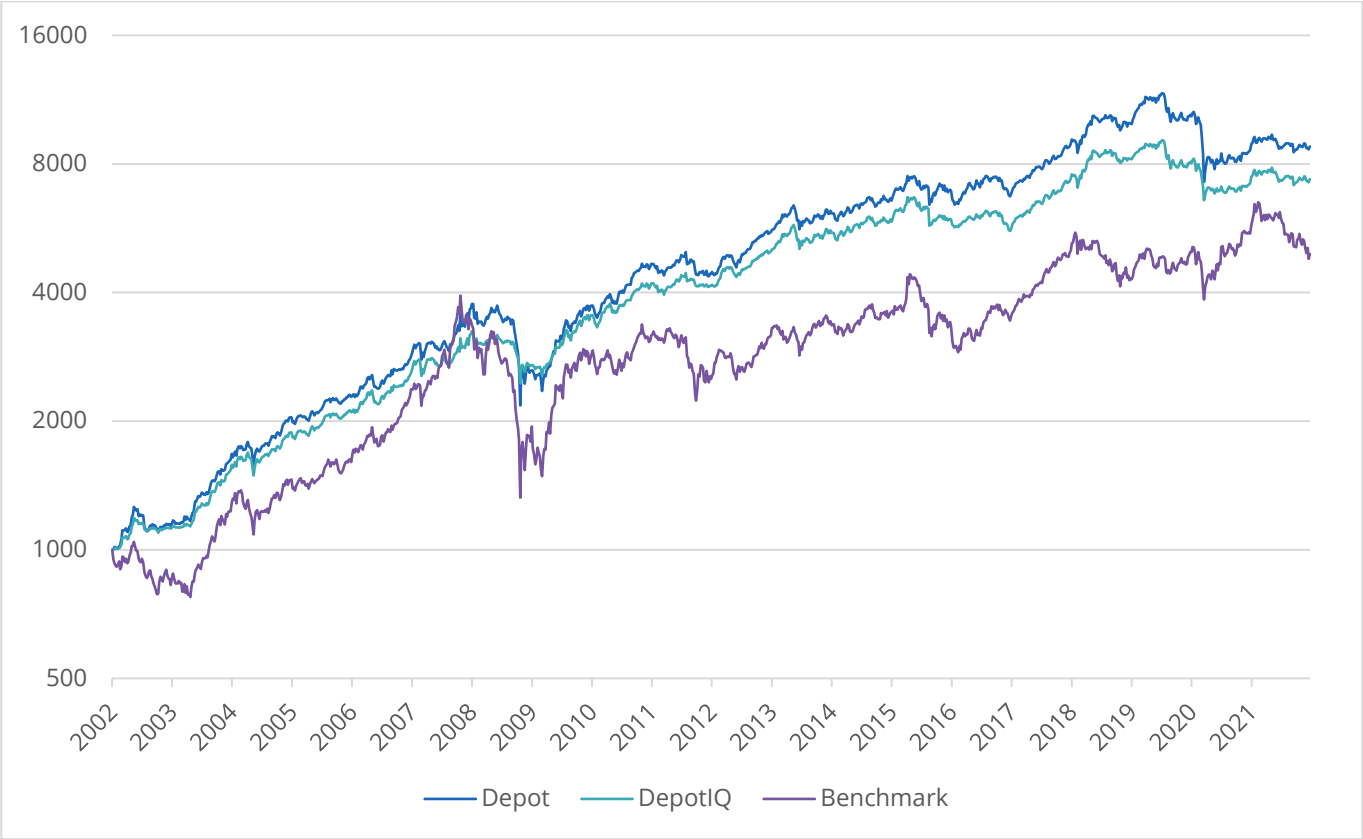


Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	11,5%	10,5%	8,3%
Annualisierte Volatilität	14,9%	11,4%	23,6%
Maximaler Drawdown	42,1%	27,6%	66,3%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,766	0,922	0,351

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Safety	80%
Verkaufskriterium 2	Safety	80%
Depotumschlagsfaktor	0,36	

Max 3 Jahre rollierend	115,8%	105,0%	194,9%
Min 3 Jahre rollierend	-16,5%	-15,5%	-18,4%
Max 5 Jahre rollierend	222,8%	186,7%	361,2%
Min 5 Jahre rollierend	1,2%	2,9%	-23,9%
Anteil Outperformance 1 Jahr	54,4%	48,0%	---



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	31,0%	31,6%	-15,8%
30.12.2002	bis	29.12.2003	-5,7%	9,6%	30,5%
29.12.2003	bis	27.12.2004	7,4%	1,5%	-6,3%
27.12.2004	bis	26.12.2005	0,9%	1,8%	-10,4%
26.12.2005	bis	25.12.2006	-19,5%	2,8%	-2,3%
25.12.2006	bis	31.12.2007	-19,4%	-0,7%	3,2%
31.12.2007	bis	29.12.2008	19,5%	8,2%	-9,1%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-14,9%	5,1%	86,7%
28.12.2009	bis	27.12.2010	13,7%	11,9%	0,8%
27.12.2010	bis	26.12.2011	13,8%	4,8%	-17,4%
26.12.2011	bis	31.12.2012	0,5%	-4,0%	-5,1%
31.12.2012	bis	30.12.2013	4,3%	5,6%	-5,5%
30.12.2013	bis	29.12.2014	2,4%	-1,4%	-13,9%
29.12.2014	bis	28.12.2015	9,5%	5,9%	-4,8%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-4,2%	1,2%	-9,7%
26.12.2016	bis	25.12.2017	-13,2%	-11,0%	-20,7%
25.12.2017	bis	31.12.2018	25,8%	10,7%	-20,2%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-10,4%	-9,3%	4,7%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-27,9%	-11,0%	12,4%
28.12.2020	bis	27.12.2021	12,8%	16,6%	2,2%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	13,4%	27,3%	31,6%	33,7%	29,4%	21,4%	29,6%	22,2%	25,5%	4,9%	15,4%
27.12.2004	bis	28.12.2009	14,0%	16,8%	20,7%	21,2%	13,7%	19,6%	21,3%	23,0%	18,5%	19,6%	13,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	5,0%	7,9%	9,0%	12,6%	6,0%	3,9%	6,4%	-2,1%	-1,7%	-0,3%	-8,5%
29.12.2014	bis	30.12.2019	6,8%	8,9%	5,7%	4,4%	9,0%	4,8%	8,5%	9,0%	9,1%	-1,7%	-7,0%
30.12.2019	bis	27.12.2021	-0,6%	2,0%	3,4%	-0,3%	8,1%	2,7%	-1,6%	-1,6%	12,1%	-0,6%	12,5%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	19,8%	14,8%	18,5%	21,3%	22,7%	23,9%	24,3%	27,2%	30,9%	28,3%	34,7%
27.12.2004	bis	28.12.2009	33,0%	23,1%	25,0%	30,0%	31,3%	33,7%	35,7%	41,4%	42,3%	48,9%	45,6%
28.12.2009	bis	29.12.2014	18,2%	12,4%	15,8%	18,0%	20,0%	21,3%	22,8%	25,0%	26,6%	27,2%	28,8%
29.12.2014	bis	30.12.2019	19,0%	12,4%	16,4%	18,6%	19,1%	21,5%	24,8%	25,9%	26,8%	27,2%	29,7%
30.12.2019	bis	27.12.2021	23,3%	15,5%	19,6%	21,7%	24,3%	25,7%	25,3%	28,0%	29,3%	31,1%	35,0%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	25,7%	16,4%	20,9%	23,2%	28,5%	28,5%	29,7%	28,9%	36,7%	42,9%	44,0%
27.12.2004	bis	28.12.2009	66,3%	48,0%	56,8%	62,9%	71,2%	69,7%	68,7%	76,3%	79,5%	82,2%	80,1%
28.12.2009	bis	29.12.2014	33,6%	20,2%	29,4%	32,4%	40,3%	45,3%	40,2%	47,8%	46,5%	50,0%	52,2%
29.12.2014	bis	30.12.2019	34,3%	20,3%	25,6%	38,4%	34,1%	42,4%	40,0%	42,2%	39,7%	48,8%	63,8%
30.12.2019	bis	27.12.2021	26,3%	22,4%	24,7%	28,3%	28,4%	27,3%	31,4%	28,1%	26,6%	33,1%	34,6%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	27,1%	23,6%	13,4%	12,1%	10,2%	19,8%	12,8%	11,6%	25,7%
27.12.2004	bis	28.12.2009	12,6%	13,3%	14,0%	20,2%	13,6%	33,0%	42,1%	24,6%	66,3%
28.12.2009	bis	29.12.2014	12,3%	10,9%	5,0%	10,6%	9,4%	18,2%	12,2%	12,2%	33,6%
29.12.2014	bis	30.12.2019	9,4%	6,4%	6,8%	12,4%	11,0%	19,0%	14,4%	16,8%	34,3%
30.12.2019	bis	27.12.2021	-8,1%	-4,6%	-0,6%	18,1%	12,1%	23,3%	31,5%	20,0%	26,2%

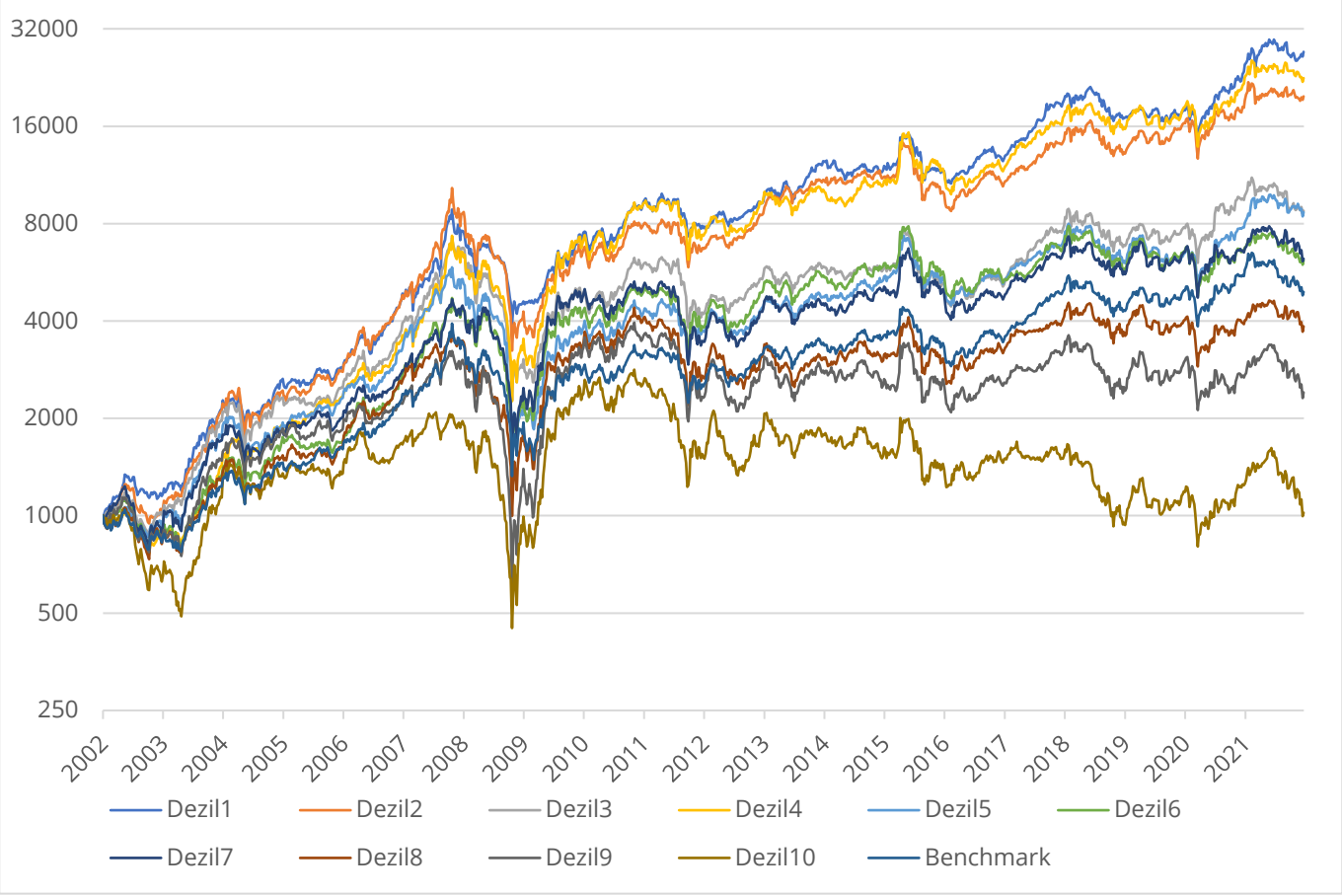
Technischer Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Hong Kong
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	Hang Seng Comp
Durchschnittliche Anzahl Aktien	276	Scoring-Modell:	Technischer Score

Dezilanalyse

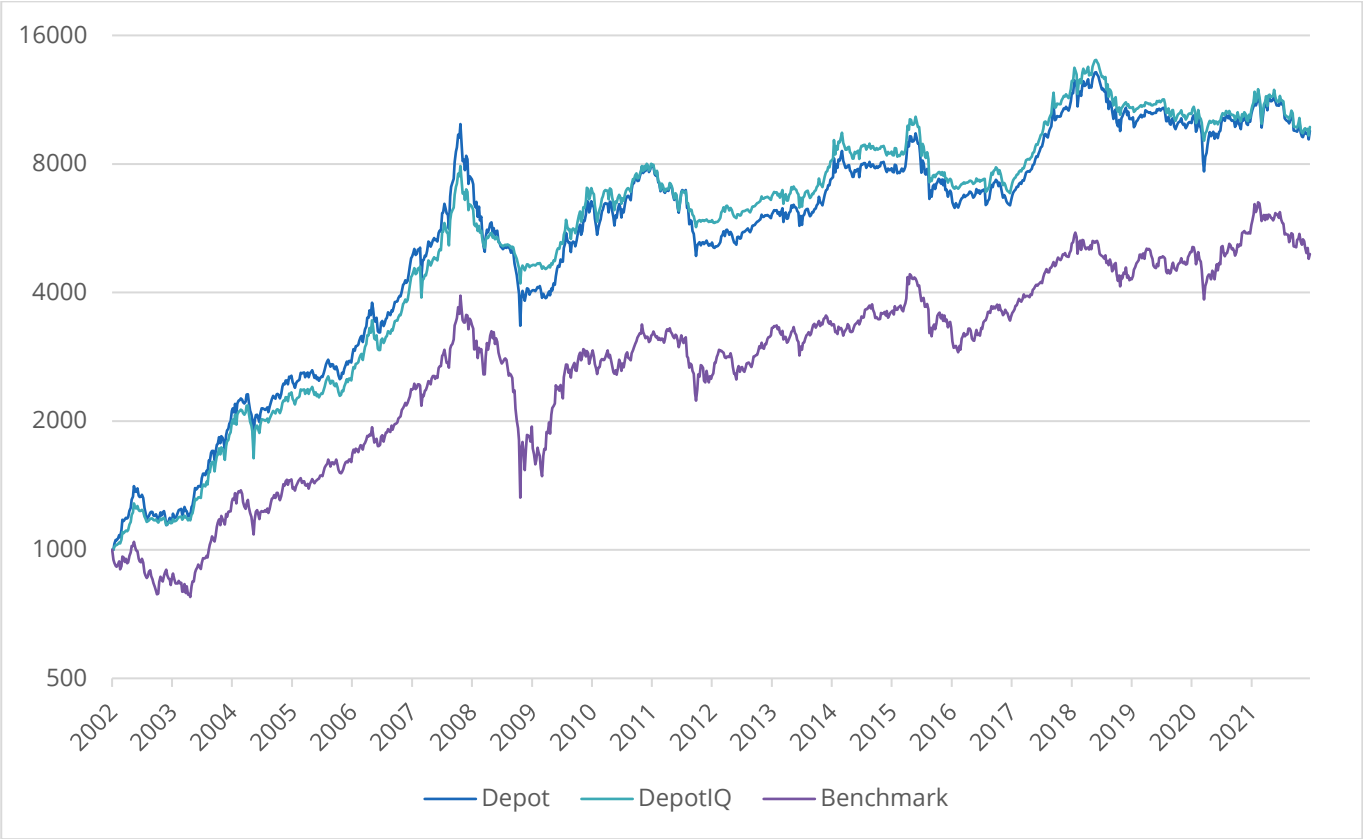
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	8,3%	17,9%	16,1%	11,5%	16,8%	11,4%	9,5%	9,6%	7,0%	4,5%	0,1%
Annualisierte Volatilität	23,6%	22,1%	24,1%	25,5%	26,3%	25,7%	26,0%	27,2%	27,7%	32,4%	33,5%
Maximaler Drawdown	66,3%	56,0%	68,6%	68,6%	69,2%	73,4%	67,6%	67,5%	73,0%	81,5%	78,5%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,351	0,812	0,665	0,449	0,640	0,443	0,365	0,351	0,251	0,138	0,003
Max 3 Jahre rollierend	194,9%	291,4%	370,1%	248,4%	326,6%	244,0%	216,6%	174,6%	191,6%	310,1%	266,6%
Min 3 Jahre rollierend	-18,4%	-0,9%	-22,8%	-23,1%	-2,3%	-27,3%	-14,2%	-29,9%	-30,7%	-65,0%	-63,1%
Max 5 Jahre rollierend	361,2%	660,9%	946,5%	678,3%	792,7%	546,2%	447,6%	447,7%	379,2%	372,8%	308,0%
Min 5 Jahre rollierend	-23,9%	-0,2%	-24,7%	-28,8%	2,6%	-33,9%	-32,7%	-19,2%	-35,0%	-59,2%	-58,4%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	81,5%	70,2%	56,5%	79,4%	57,3%	53,6%	45,6%	44,8%	27,4%	25,8%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	11,9%	12,0%	8,3%
Annualisierte Volatilität	23,4%	20,0%	23,6%
Maximaler Drawdown	66,3%	47,0%	66,3%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,510	0,601	0,351
Max 3 Jahre rollierend	329,3%	271,9%	194,9%
Min 3 Jahre rollierend	-24,8%	-23,9%	-18,4%
Max 5 Jahre rollierend	725,1%	574,9%	361,2%
Min 5 Jahre rollierend	-40,5%	-17,6%	-23,9%
Anteil Outperformance 1 Jahr	52,0%	50,8%	---

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Technisch	70%
Verkaufskriterium 2	Technisch	70%
Depotumschlagsfaktor	1,44	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	33,4%	26,2%	-9,2%
30.12.2002	bis	29.12.2003	23,3%	46,8%	29,8%
29.12.2003	bis	27.12.2004	8,3%	0,1%	1,7%
27.12.2004	bis	26.12.2005	-2,4%	1,1%	-10,8%
26.12.2005	bis	25.12.2006	26,1%	23,9%	-17,5%
25.12.2006	bis	31.12.2007	10,6%	23,2%	-24,1%
31.12.2007	bis	29.12.2008	1,9%	1,3%	-8,8%
29.12.2008	bis	28.12.2009	0,9%	4,8%	107,2%
28.12.2009	bis	27.12.2010	12,7%	11,2%	-3,1%
27.12.2010	bis	26.12.2011	-15,4%	4,4%	-18,4%
26.12.2011	bis	31.12.2012	-9,8%	-1,7%	-4,3%
31.12.2012	bis	30.12.2013	15,2%	22,7%	-10,2%
30.12.2013	bis	29.12.2014	0,7%	-6,7%	-16,4%
29.12.2014	bis	28.12.2015	-5,8%	-0,2%	4,1%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-8,4%	4,4%	-2,8%
26.12.2016	bis	25.12.2017	25,7%	0,6%	-29,1%
25.12.2017	bis	31.12.2018	6,8%	3,8%	-16,5%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-17,0%	-0,5%	6,9%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-10,3%	10,9%	-13,4%
28.12.2020	bis	27.12.2021	5,9%	22,3%	-3,3%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002 bis 27.12.2004	13,4%	37,9%	34,4%	32,4%	24,0%	23,6%	19,0%	22,1%	14,9%	22,4%	9,8%
27.12.2004 bis 28.12.2009	14,0%	22,8%	21,8%	15,8%	29,5%	14,8%	20,1%	21,0%	17,1%	12,2%	12,3%
28.12.2009 bis 29.12.2014	5,0%	9,8%	11,3%	3,7%	8,7%	7,3%	6,9%	1,0%	-1,9%	-4,8%	-8,3%
29.12.2014 bis 30.12.2019	6,8%	8,8%	8,1%	6,2%	11,7%	3,9%	2,1%	5,6%	5,8%	3,3%	-4,9%
30.12.2019 bis 27.12.2021	-0,6%	23,1%	9,9%	6,1%	11,0%	15,8%	-3,1%	-2,4%	-2,0%	-10,1%	-7,4%

Annualisierte Volatilität	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002 bis 27.12.2004	19,8%	23,1%	25,5%	24,5%	22,3%	23,5%	23,0%	25,4%	24,0%	26,0%	31,3%
27.12.2004 bis 28.12.2009	33,0%	28,6%	32,1%	32,9%	36,5%	34,9%	34,5%	36,2%	36,8%	45,8%	43,4%
28.12.2009 bis 29.12.2014	18,2%	16,7%	17,9%	20,0%	21,0%	20,4%	21,6%	22,0%	24,9%	26,4%	29,5%
29.12.2014 bis 30.12.2019	19,0%	18,0%	19,3%	22,8%	21,2%	20,7%	22,4%	22,6%	22,6%	26,1%	27,2%
30.12.2019 bis 27.12.2021	23,3%	23,0%	23,5%	24,5%	25,0%	25,0%	24,4%	26,1%	25,3%	28,8%	32,3%

Maximaler Drawdown	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002 bis 27.12.2004	25,7%	24,7%	34,1%	32,7%	26,1%	31,2%	29,9%	35,2%	30,7%	34,1%	53,1%
27.12.2004 bis 28.12.2009	66,3%	56,0%	68,6%	68,6%	69,2%	73,4%	67,6%	67,5%	73,0%	81,5%	78,5%
28.12.2009 bis 29.12.2014	33,6%	26,2%	28,8%	39,4%	34,7%	34,6%	39,0%	44,7%	49,9%	50,5%	56,6%
29.12.2014 bis 30.12.2019	34,3%	29,9%	38,6%	42,4%	35,6%	39,0%	40,1%	39,8%	37,7%	38,9%	53,7%
30.12.2019 bis 27.12.2021	26,3%	23,0%	25,0%	24,4%	27,7%	26,2%	29,6%	30,8%	30,0%	31,6%	38,4%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum	Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002 bis 27.12.2004	36,5%	32,4%	13,4%	21,9%	19,9%	19,8%	24,9%	24,9%	25,7%
27.12.2004 bis 28.12.2009	20,0%	23,9%	14,0%	28,6%	22,6%	33,0%	66,3%	46,9%	66,3%
28.12.2009 bis 29.12.2014	4,2%	4,6%	5,0%	19,9%	17,7%	18,2%	38,8%	29,0%	33,6%
29.12.2014 bis 30.12.2019	5,3%	4,4%	6,8%	20,7%	18,9%	19,0%	33,0%	33,8%	34,3%
30.12.2019 bis 27.12.2021	-2,3%	-3,5%	-0,6%	25,5%	21,6%	23,3%	26,1%	22,1%	26,2%

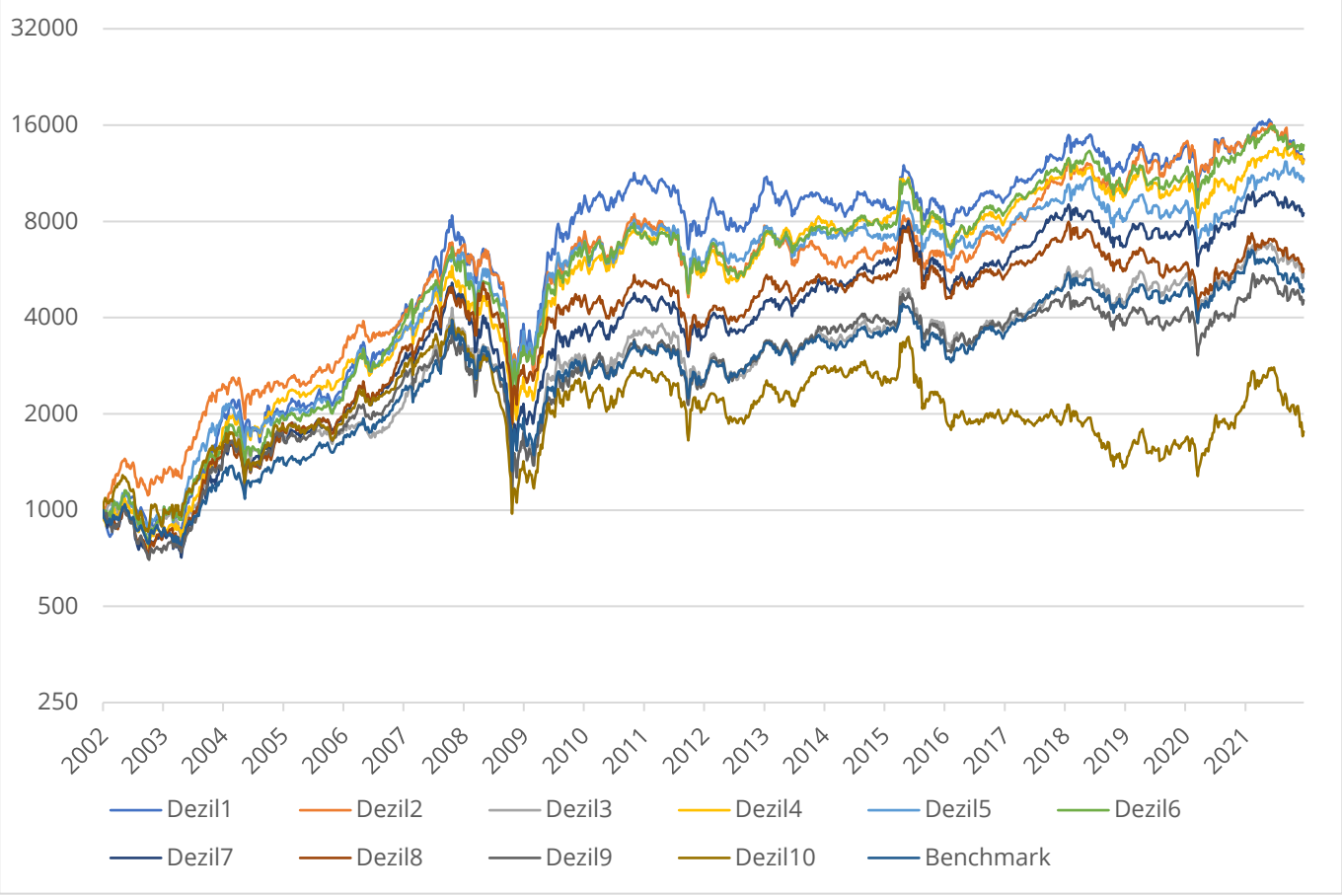
Value-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Hong Kong
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	Hang Seng Comp
Durchschnittliche Anzahl Aktien	269	Scoring-Modell:	Value-Score

Dezilanalyse

	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	8,3%	13,5%	13,4%	8,9%	13,4%	12,7%	14,0%	11,3%	9,1%	7,8%	2,9%
Annualisierte Volatilität	23,6%	30,4%	26,6%	26,1%	26,8%	26,6%	26,5%	25,6%	25,8%	25,5%	26,8%
Maximaler Drawdown	66,3%	75,0%	65,8%	73,9%	73,4%	65,8%	70,1%	73,7%	63,9%	68,5%	75,3%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,351	0,443	0,505	0,341	0,498	0,477	0,529	0,440	0,351	0,307	0,107
Max 3 Jahre rollierend	194,9%	338,9%	199,7%	175,2%	271,4%	244,5%	281,1%	228,4%	240,5%	182,6%	152,6%
Min 3 Jahre rollierend	-18,4%	-29,1%	-26,6%	-30,6%	-35,1%	-20,2%	-12,5%	-23,8%	-28,5%	-30,9%	-45,4%
Max 5 Jahre rollierend	361,2%	839,7%	480,2%	396,5%	605,5%	607,1%	689,4%	591,6%	563,9%	389,8%	327,8%
Min 5 Jahre rollierend	-23,9%	-27,4%	-28,9%	-33,9%	-20,1%	-23,0%	-7,0%	-24,0%	-38,5%	-27,9%	-58,2%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	56,9%	62,9%	55,2%	54,4%	46,0%	67,7%	62,9%	51,6%	44,0%	38,3%

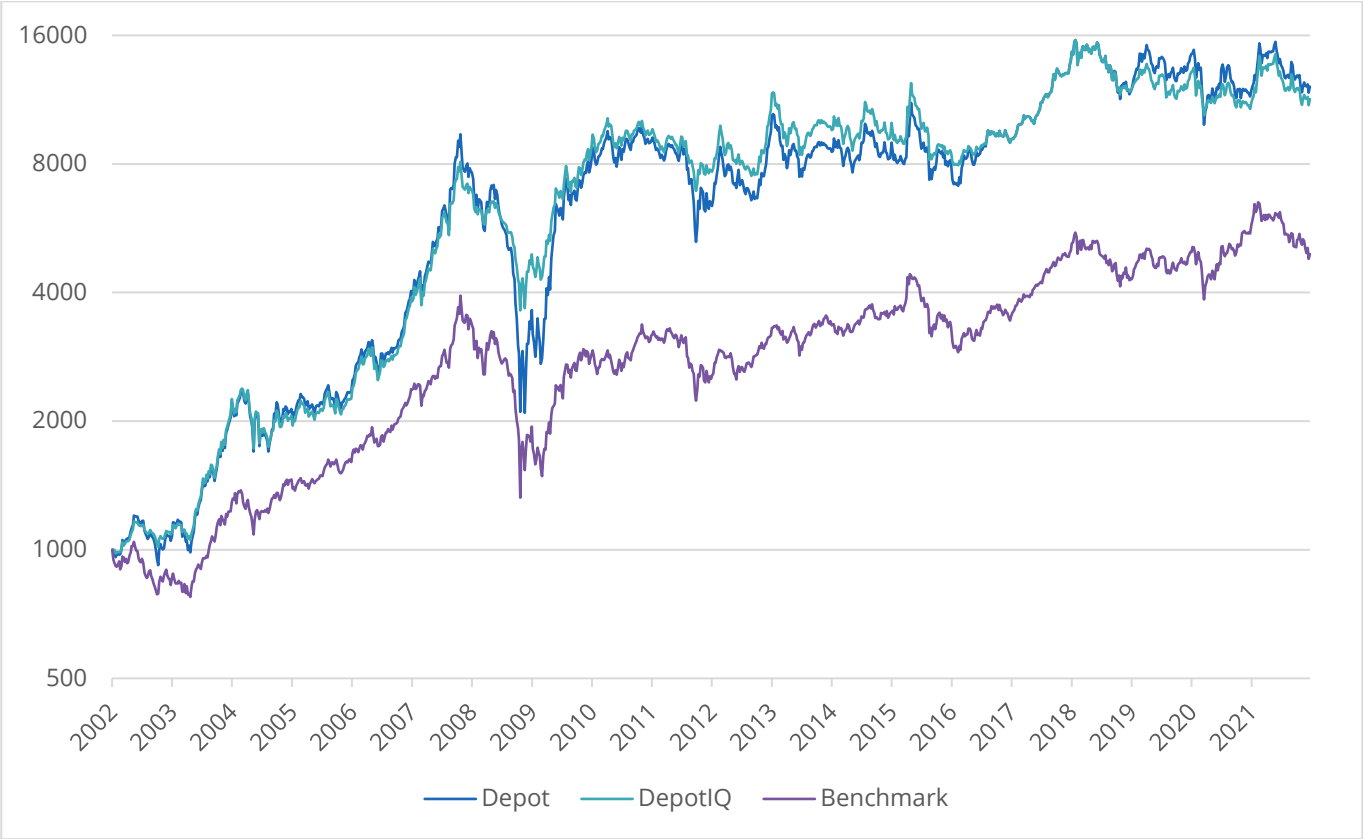


Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	13,3%	12,9%	8,3%
Annualisierte Volatilität	32,2%	24,7%	23,6%
Maximaler Drawdown	77,7%	55,1%	66,3%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,412	0,522	0,351

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Value	90%
Verkaufskriterium 2	Value	90%
Depotumschlagsfaktor	1,22	

Max 3 Jahre rollierend	370,8%	317,5%	194,9%
Min 3 Jahre rollierend	-31,1%	-31,9%	-18,4%
Max 5 Jahre rollierend	828,2%	659,6%	361,2%
Min 5 Jahre rollierend	-26,6%	-14,9%	-23,9%
Anteil Outperformance 1 Jahr	58,5%	54,4%	---



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	22,3%	23,8%	-1,4%
30.12.2002	bis	29.12.2003	45,5%	53,3%	29,2%
29.12.2003	bis	27.12.2004	-14,7%	-12,8%	4,3%
27.12.2004	bis	26.12.2005	-1,3%	6,2%	-8,7%
26.12.2005	bis	25.12.2006	24,9%	9,7%	-0,3%
25.12.2006	bis	31.12.2007	49,3%	24,6%	-15,1%
31.12.2007	bis	29.12.2008	-9,4%	-2,7%	-9,3%
29.12.2008	bis	28.12.2009	82,5%	73,7%	18,3%
28.12.2009	bis	27.12.2010	3,9%	5,8%	1,3%
27.12.2010	bis	26.12.2011	-9,5%	-11,1%	-2,9%
26.12.2011	bis	31.12.2012	20,8%	6,4%	-5,1%
31.12.2012	bis	30.12.2013	-16,5%	-17,1%	11,9%
30.12.2013	bis	29.12.2014	-9,4%	-5,6%	-7,6%
29.12.2014	bis	28.12.2015	3,3%	4,3%	-4,1%
28.12.2015	bis	26.12.2016	9,1%	3,9%	-9,0%
26.12.2016	bis	25.12.2017	7,6%	3,7%	-31,6%
25.12.2017	bis	31.12.2018	-0,3%	5,7%	-8,0%
31.12.2018	bis	30.12.2019	5,6%	12,4%	-2,0%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-29,9%	-11,9%	7,2%
28.12.2020	bis	27.12.2021	16,1%	2,5%	3,2%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	13,4%	26,5%	35,8%	18,9%	30,4%	25,8%	25,2%	20,0%	21,6%	20,2%	21,6%
27.12.2004	bis	28.12.2009	14,0%	34,1%	22,7%	12,0%	21,5%	26,8%	26,8%	15,9%	20,0%	9,6%	5,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	5,0%	0,2%	-1,3%	4,2%	6,3%	1,5%	3,5%	10,5%	3,6%	7,4%	0,9%
29.12.2014	bis	30.12.2019	6,8%	8,9%	16,6%	7,9%	6,1%	4,9%	8,1%	4,9%	2,0%	1,2%	-8,1%
30.12.2019	bis	27.12.2021	-0,6%	-3,9%	-5,6%	1,8%	7,4%	10,6%	11,1%	5,6%	-1,8%	4,2%	3,8%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	19,8%	29,7%	24,6%	24,4%	25,4%	23,8%	25,2%	25,2%	24,6%	25,9%	25,8%
27.12.2004	bis	28.12.2009	33,0%	42,3%	33,6%	33,6%	36,9%	35,0%	35,4%	34,2%	34,1%	34,1%	31,5%
28.12.2009	bis	29.12.2014	18,2%	23,6%	23,0%	22,1%	21,4%	22,6%	21,0%	19,5%	19,9%	20,0%	22,6%
29.12.2014	bis	30.12.2019	19,0%	22,6%	22,4%	22,6%	21,2%	22,4%	22,2%	21,8%	22,0%	20,0%	25,0%
30.12.2019	bis	27.12.2021	23,3%	27,4%	27,5%	25,2%	24,0%	25,2%	24,6%	23,5%	24,8%	25,2%	29,6%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	25,7%	27,6%	25,7%	26,4%	30,3%	28,0%	32,5%	30,7%	29,6%	31,7%	33,5%
27.12.2004	bis	28.12.2009	66,3%	75,0%	65,8%	73,9%	73,4%	65,8%	70,1%	73,7%	63,9%	68,5%	75,3%
28.12.2009	bis	29.12.2014	33,6%	42,4%	45,1%	40,6%	38,8%	40,2%	39,7%	36,8%	41,9%	37,6%	41,0%
29.12.2014	bis	30.12.2019	34,3%	35,6%	33,7%	34,7%	39,3%	33,7%	39,8%	40,8%	40,4%	35,0%	61,1%
30.12.2019	bis	27.12.2021	26,3%	29,4%	28,2%	30,4%	30,9%	29,1%	25,7%	27,6%	29,5%	29,3%	39,1%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	28,5%	26,9%	13,4%	28,3%	25,0%	19,8%	27,6%	27,6%	25,7%
27.12.2004	bis	28.12.2009	30,0%	32,7%	14,0%	44,4%	29,4%	33,0%	77,7%	55,1%	66,3%
28.12.2009	bis	29.12.2014	1,1%	1,9%	5,0%	27,9%	22,8%	18,2%	46,3%	32,4%	33,6%
29.12.2014	bis	30.12.2019	11,5%	7,1%	6,8%	24,1%	21,5%	19,0%	36,0%	35,8%	34,3%
30.12.2019	bis	27.12.2021	-7,8%	-6,5%	-0,6%	28,7%	23,1%	23,3%	33,2%	24,0%	26,2%

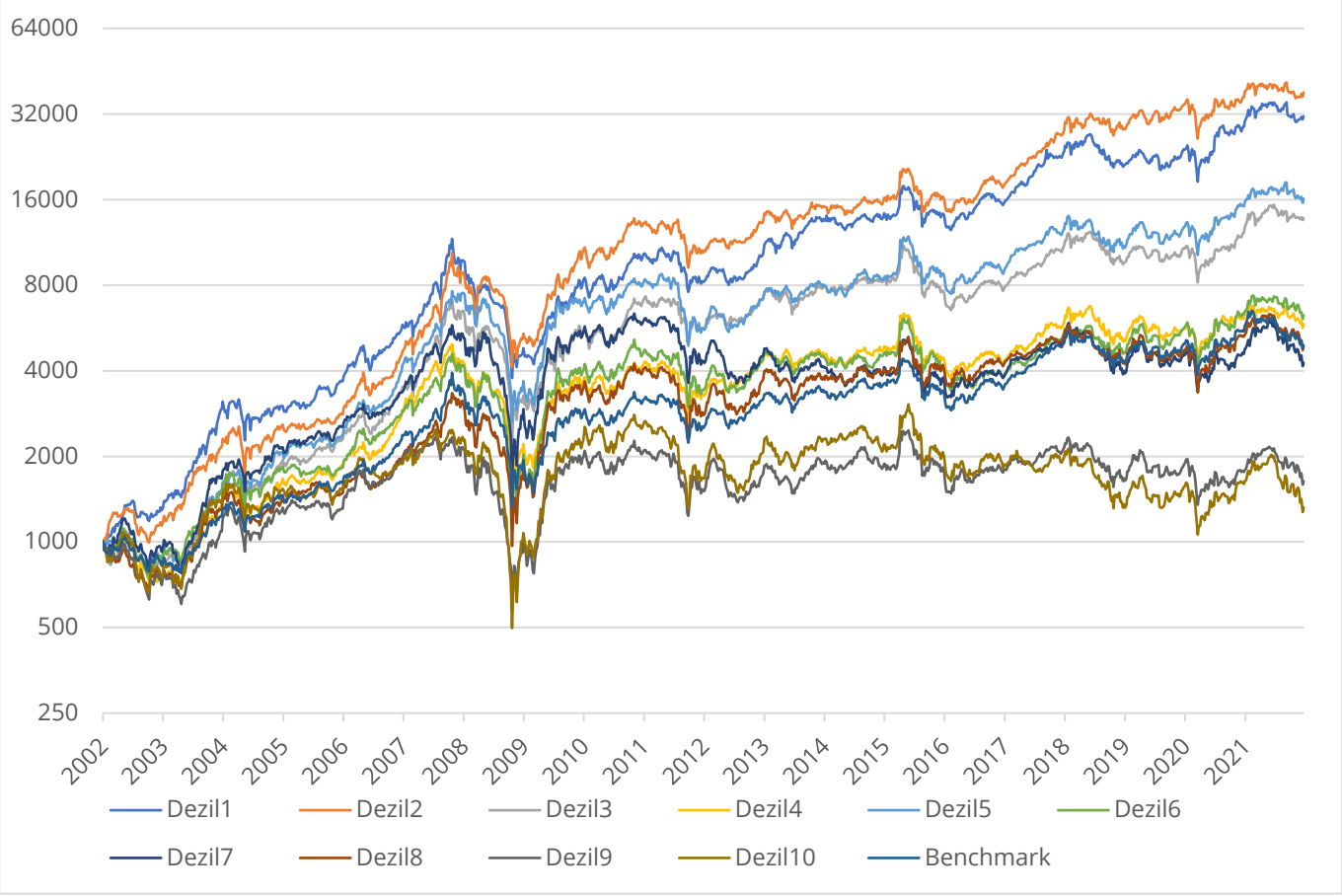
Kombi-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Hong Kong
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	Hang Seng Comp
Durchschnittliche Anzahl Aktien	268	Scoring-Modell:	Kombi-Score

Dezilanalyse

	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	8,3%	18,8%	19,9%	14,0%	9,2%	14,9%	9,6%	7,5%	8,2%	2,5%	1,4%
Annualisierte Volatilität	23,6%	24,3%	25,0%	24,8%	24,8%	24,9%	27,6%	28,7%	29,0%	29,1%	32,0%
Maximaler Drawdown	66,3%	67,7%	60,5%	68,6%	68,6%	65,4%	74,6%	71,7%	71,0%	75,2%	80,0%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,351	0,772	0,796	0,565	0,371	0,599	0,348	0,262	0,283	0,085	0,044
Max 3 Jahre rollierend	194,9%	311,8%	355,0%	332,5%	252,5%	310,6%	199,6%	273,3%	197,6%	190,4%	234,9%
Min 3 Jahre rollierend	-18,4%	-15,0%	0,3%	-15,1%	-21,3%	-17,5%	-31,3%	-42,3%	-30,4%	-51,6%	-63,1%
Max 5 Jahre rollierend	361,2%	848,9%	880,9%	776,7%	552,4%	777,3%	489,4%	562,1%	357,9%	248,8%	340,0%
Min 5 Jahre rollierend	-23,9%	-20,8%	11,8%	-14,3%	-23,0%	-12,1%	-24,1%	-46,1%	-25,7%	-42,6%	-64,8%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	75,8%	81,5%	69,4%	50,0%	78,2%	52,0%	40,7%	41,1%	31,9%	29,0%

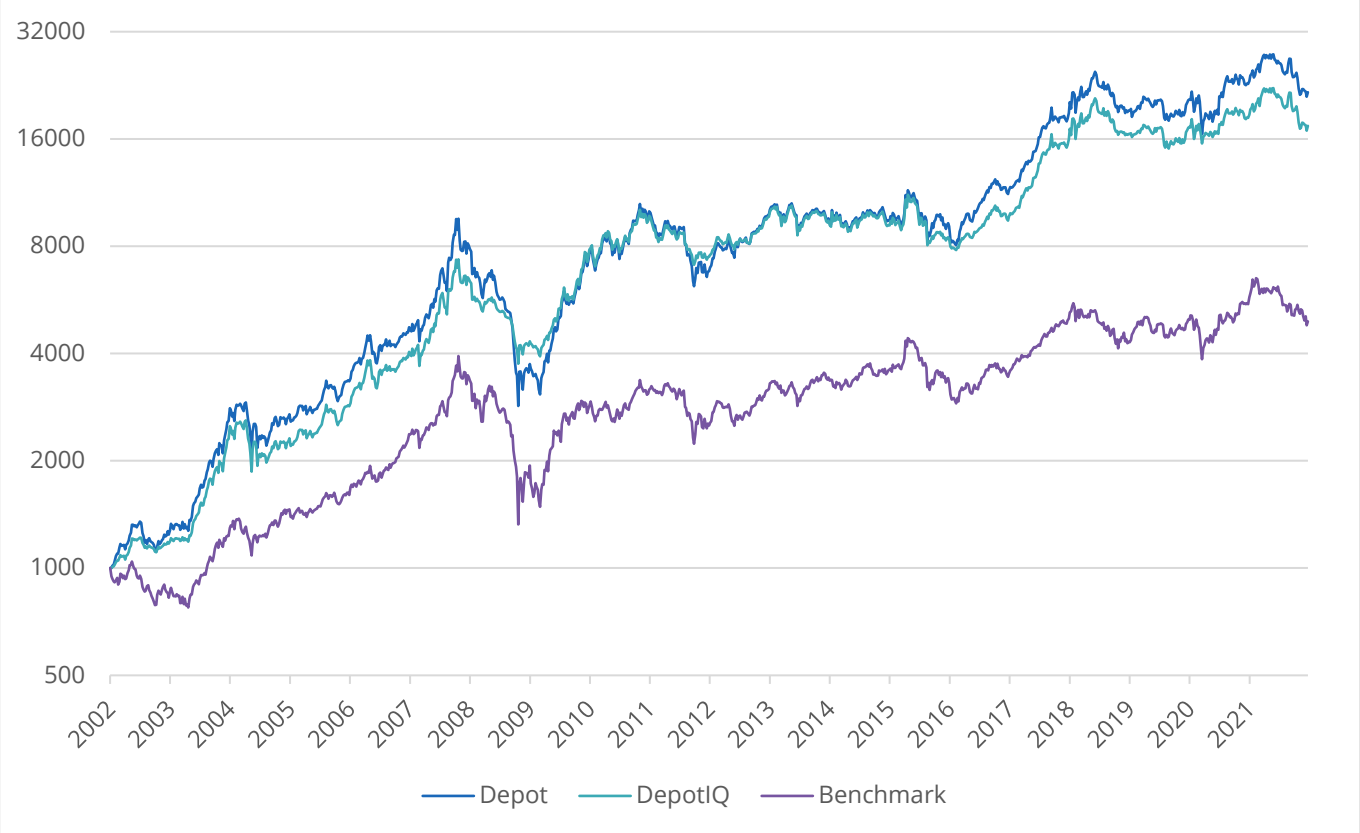


Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	16,6%	15,3%	8,3%
Annualisierte Volatilität	26,0%	21,5%	23,6%
Maximaler Drawdown	70,2%	49,1%	66,3%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,637	0,711	0,351

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Kombi	70%
Verkaufskriterium 2	Kombi	70%
Depotumschlagsfaktor	1,08	

Max 3 Jahre rollierend	278,4%	238,4%	194,9%
Min 3 Jahre rollierend	-23,2%	-24,4%	-18,4%
Max 5 Jahre rollierend	728,6%	551,2%	361,2%
Min 5 Jahre rollierend	-13,4%	-15,0%	-23,9%
Anteil Outperformance 1 Jahr	62,5%	62,5%	---



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	41,5%	39,0%	-10,0%
30.12.2002	bis	29.12.2003	59,7%	59,7%	19,7%
29.12.2003	bis	27.12.2004	-15,5%	-8,0%	-3,6%
27.12.2004	bis	26.12.2005	14,6%	4,7%	-10,7%
26.12.2005	bis	25.12.2006	-4,4%	15,8%	-5,4%
25.12.2006	bis	31.12.2007	25,6%	34,4%	-32,4%
31.12.2007	bis	29.12.2008	-8,2%	0,5%	-9,4%
29.12.2008	bis	28.12.2009	50,4%	32,4%	62,2%
28.12.2009	bis	27.12.2010	22,9%	13,3%	-1,9%
27.12.2010	bis	26.12.2011	-12,7%	0,3%	-11,5%
26.12.2011	bis	31.12.2012	19,9%	0,7%	-6,4%
31.12.2012	bis	30.12.2013	-10,1%	15,1%	2,3%
30.12.2013	bis	29.12.2014	-5,9%	-2,4%	-10,4%
29.12.2014	bis	28.12.2015	2,9%	8,6%	3,6%
28.12.2015	bis	26.12.2016	20,0%	6,5%	-8,8%
26.12.2016	bis	25.12.2017	18,8%	8,8%	-30,7%
25.12.2017	bis	31.12.2018	18,2%	10,7%	-12,5%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-8,4%	2,5%	-1,9%
30.12.2019	bis	28.12.2020	0,7%	2,5%	-12,1%
28.12.2020	bis	27.12.2021	5,4%	17,0%	-1,8%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	13,4%	44,6%	37,0%	23,8%	17,2%	27,5%	22,0%	29,0%	11,9%	8,7%	15,1%
27.12.2004	bis	28.12.2009	14,0%	21,8%	32,3%	23,0%	17,6%	27,2%	16,9%	20,1%	19,5%	8,9%	7,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	5,0%	11,4%	8,5%	9,0%	5,5%	3,9%	2,7%	-6,1%	2,9%	-1,3%	-1,2%
29.12.2014	bis	30.12.2019	6,8%	11,6%	17,1%	5,6%	3,5%	8,9%	4,6%	3,2%	3,7%	0,3%	-5,8%
30.12.2019	bis	27.12.2021	-0,6%	14,2%	5,0%	13,0%	1,8%	12,1%	5,3%	-3,4%	1,3%	-6,5%	-8,0%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	19,8%	26,4%	26,7%	23,8%	24,0%	22,9%	23,9%	26,8%	24,4%	27,3%	30,9%
27.12.2004	bis	28.12.2009	33,0%	30,5%	33,4%	34,4%	32,9%	31,7%	37,6%	38,7%	38,9%	39,2%	40,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	18,2%	19,0%	18,8%	19,3%	19,1%	21,0%	22,0%	22,6%	24,9%	23,7%	27,6%
29.12.2014	bis	30.12.2019	19,0%	19,9%	19,8%	19,1%	21,2%	22,4%	22,9%	22,7%	24,0%	24,1%	26,7%
30.12.2019	bis	27.12.2021	23,3%	25,6%	23,2%	22,0%	23,4%	23,0%	26,5%	28,4%	27,8%	26,0%	30,9%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	25,7%	28,3%	32,6%	27,7%	29,1%	26,6%	32,8%	34,9%	32,4%	39,5%	38,7%
27.12.2004	bis	28.12.2009	66,3%	67,7%	60,5%	68,6%	68,6%	65,4%	74,6%	71,7%	71,0%	75,2%	80,0%
28.12.2009	bis	29.12.2014	33,6%	30,1%	32,9%	33,1%	37,1%	43,4%	42,1%	44,5%	44,5%	45,6%	53,0%
29.12.2014	bis	30.12.2019	34,3%	29,9%	29,7%	40,6%	41,0%	37,3%	44,2%	37,3%	33,8%	40,0%	56,9%
30.12.2019	bis	27.12.2021	26,3%	25,3%	27,4%	25,7%	26,6%	23,4%	31,6%	30,3%	31,6%	31,0%	37,2%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	38,8%	31,7%	13,4%	25,5%	23,2%	19,8%	28,3%	28,3%	25,7%
27.12.2004	bis	28.12.2009	22,3%	26,8%	14,0%	32,7%	24,4%	33,0%	70,2%	49,1%	66,3%
28.12.2009	bis	29.12.2014	5,3%	4,1%	5,0%	21,9%	18,6%	18,2%	41,2%	29,9%	33,6%
29.12.2014	bis	30.12.2019	16,7%	13,4%	6,8%	22,2%	20,4%	19,0%	30,0%	30,0%	34,3%
30.12.2019	bis	27.12.2021	2,7%	0,6%	-0,6%	26,5%	20,9%	23,3%	24,1%	24,0%	26,2%

Australien – ASX300

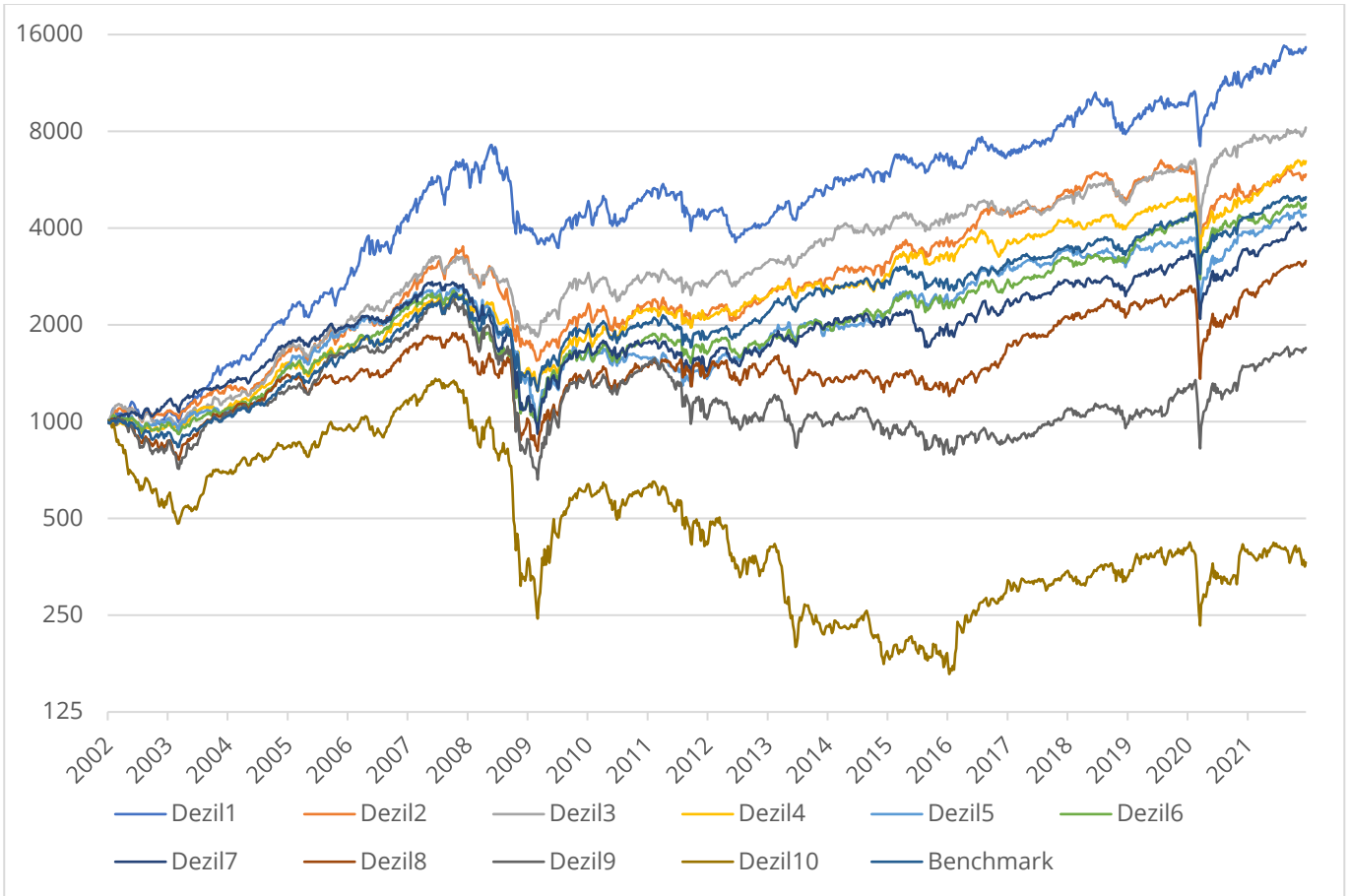
Trend-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Australien
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	ASX300
Durchschnittliche Anzahl Aktien	192	Scoring-Modell:	Trend-Score

Dezilanalyse

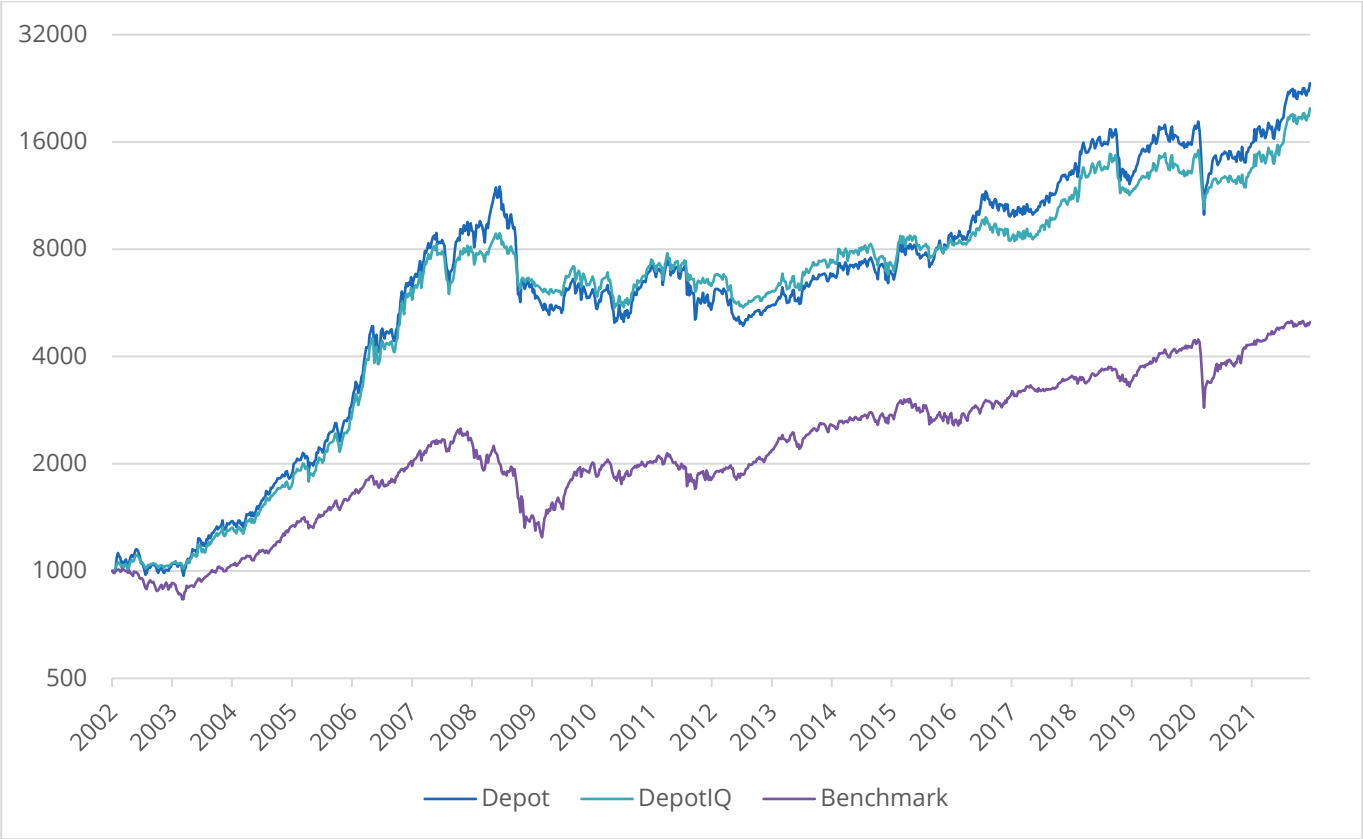
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	8,4%	14,3%	9,2%	11,1%	9,8%	7,7%	8,1%	7,2%	5,9%	2,7%	-4,9%
Annualisierte Volatilität	16,1%	21,8%	17,6%	16,8%	15,7%	17,0%	16,2%	17,7%	19,7%	22,2%	27,5%
Maximaler Drawdown	50,5%	52,1%	55,9%	43,9%	50,5%	63,6%	61,6%	66,3%	57,0%	72,6%	87,9%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,519	0,658	0,525	0,661	0,620	0,451	0,498	0,405	0,301	0,120	-0,179
Max 3 Jahre rollierend	115,4%	256,2%	149,8%	162,3%	103,4%	137,2%	121,6%	105,0%	90,5%	136,7%	110,1%
Min 3 Jahre rollierend	-27,5%	-30,3%	-37,6%	-27,4%	-30,9%	-52,4%	-45,7%	-55,5%	-42,9%	-61,0%	-75,1%
Max 5 Jahre rollierend	178,6%	543,7%	235,3%	226,8%	164,5%	166,7%	170,4%	160,5%	127,7%	195,6%	140,8%
Min 5 Jahre rollierend	-21,1%	-40,2%	-33,3%	-18,1%	-9,7%	-42,1%	-36,2%	-45,0%	-28,6%	-59,5%	-75,2%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	67,7%	50,4%	62,9%	52,4%	43,6%	55,7%	40,7%	45,6%	37,9%	25,4%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	17,0%	16,1%	8,4%
Annualisierte Volatilität	26,5%	21,8%	16,1%
Maximaler Drawdown	59,3%	38,3%	50,5%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,643	0,736	0,519
Max 3 Jahre rollierend	512,8%	495,2%	115,4%
Min 3 Jahre rollierend	-44,5%	-32,1%	-27,5%
Max 5 Jahre rollierend	950,2%	701,9%	178,6%
Min 5 Jahre rollierend	-52,0%	-31,1%	-21,1%
Anteil Outperformance 1 Jahr	61,3%	63,3%	---

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Trend	70%
Verkaufskriterium 2	Trend	70%
Depotumschlagsfaktor	1,74	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	12,5%	15,5%	-21,9%
30.12.2002	bis	29.12.2003	18,6%	16,5%	13,8%
29.12.2003	bis	27.12.2004	4,9%	5,3%	-10,8%
27.12.2004	bis	26.12.2005	35,2%	1,2%	0,2%
26.12.2005	bis	25.12.2006	98,1%	21,0%	-4,0%
25.12.2006	bis	31.12.2007	30,9%	22,3%	-8,6%
31.12.2007	bis	29.12.2008	7,1%	-0,6%	-26,5%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-44,4%	-21,2%	37,1%
28.12.2009	bis	27.12.2010	12,3%	4,9%	0,5%
27.12.2010	bis	26.12.2011	-8,9%	-1,1%	-21,2%
26.12.2011	bis	31.12.2012	-19,1%	-13,4%	-21,1%
31.12.2012	bis	30.12.2013	3,4%	3,2%	-43,6%
30.12.2013	bis	29.12.2014	-4,7%	5,1%	-17,9%
29.12.2014	bis	28.12.2015	25,7%	13,6%	-4,7%
28.12.2015	bis	26.12.2016	0,3%	-1,7%	16,0%
26.12.2016	bis	25.12.2017	20,0%	11,7%	7,3%
25.12.2017	bis	31.12.2018	-1,6%	-4,3%	-4,1%
31.12.2018	bis	30.12.2019	1,1%	-3,5%	1,0%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-4,0%	1,0%	6,2%
28.12.2020	bis	27.12.2021	35,5%	4,8%	-12,4%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	10,1%	28,1%	17,9%	19,5%	15,1%	14,1%	13,5%	20,3%	11,6%	7,6%	-6,1%
27.12.2004	bis	28.12.2009	7,9%	16,5%	6,2%	10,3%	4,0%	1,8%	2,4%	-0,5%	-0,1%	2,1%	-5,6%
28.12.2009	bis	29.12.2014	7,1%	5,8%	7,3%	8,0%	9,2%	6,2%	5,9%	4,5%	-0,8%	-7,3%	-21,0%
29.12.2014	bis	30.12.2019	9,2%	10,3%	13,8%	8,6%	11,2%	10,4%	14,6%	9,1%	13,9%	6,1%	16,2%
30.12.2019	bis	27.12.2021	8,1%	22,3%	-1,3%	15,2%	14,6%	10,3%	4,8%	11,0%	11,2%	15,7%	-5,1%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	9,7%	12,5%	9,7%	10,1%	8,9%	9,0%	8,7%	9,4%	11,2%	14,2%	17,3%
27.12.2004	bis	28.12.2009	19,7%	27,8%	21,0%	17,8%	18,5%	21,5%	19,4%	22,8%	23,1%	27,9%	33,6%
28.12.2009	bis	29.12.2014	15,4%	20,4%	17,9%	14,7%	15,2%	15,8%	15,0%	16,8%	19,6%	22,0%	28,6%
29.12.2014	bis	30.12.2019	13,1%	18,2%	13,4%	13,4%	12,5%	12,2%	12,6%	14,1%	13,9%	17,4%	22,5%
30.12.2019	bis	27.12.2021	21,7%	26,6%	24,7%	29,9%	23,3%	25,2%	25,1%	22,7%	30,5%	26,9%	31,1%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	17,9%	14,9%	9,5%	15,8%	9,7%	10,2%	13,0%	9,3%	25,6%	30,8%	52,1%
27.12.2004	bis	28.12.2009	50,5%	52,1%	55,9%	43,9%	50,5%	63,6%	61,6%	66,3%	57,0%	72,6%	82,1%
28.12.2009	bis	29.12.2014	20,7%	34,1%	18,8%	18,5%	14,0%	23,8%	18,8%	22,1%	24,1%	47,3%	73,0%
29.12.2014	bis	30.12.2019	16,0%	25,8%	18,6%	16,4%	17,2%	12,4%	13,7%	23,4%	17,0%	21,0%	23,7%
30.12.2019	bis	27.12.2021	35,7%	32,6%	44,5%	42,6%	36,0%	40,3%	38,4%	38,6%	48,5%	38,6%	44,9%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	22,5%	19,7%	10,1%	15,8%	12,7%	9,7%	15,7%	8,5%	17,9%
27.12.2004	bis	28.12.2009	26,5%	30,3%	7,9%	32,0%	26,0%	19,7%	56,3%	33,1%	50,5%
28.12.2009	bis	29.12.2014	3,2%	2,6%	7,1%	25,1%	20,6%	15,4%	35,1%	29,5%	20,7%
29.12.2014	bis	30.12.2019	17,9%	12,4%	9,2%	23,8%	20,9%	13,1%	30,0%	23,5%	16,0%
30.12.2019	bis	27.12.2021	21,2%	22,5%	8,1%	33,5%	26,3%	21,7%	45,3%	31,6%	35,7%

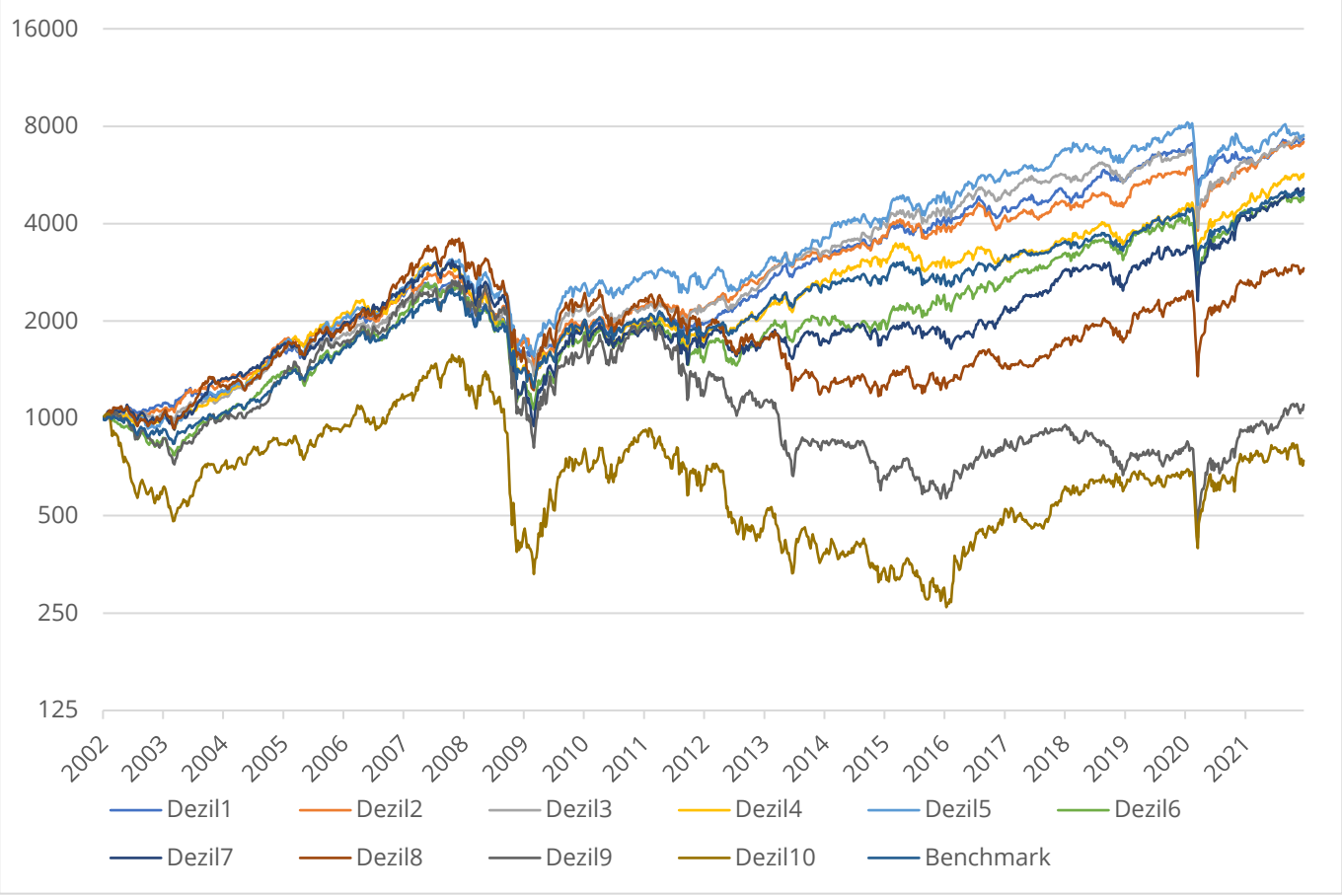
Safety-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Australien
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	ASX300
Durchschnittliche Anzahl Aktien	192	Scoring-Modell:	Safety-Score

Dezilanalyse

	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	8,4%	10,4%	10,3%	10,5%	9,1%	10,6%	8,2%	8,5%	5,5%	0,5%	-1,5%
Annualisierte Volatilität	16,1%	13,2%	14,6%	15,6%	15,9%	17,2%	17,4%	20,6%	21,7%	25,3%	29,1%
Maximaler Drawdown	50,5%	43,4%	49,1%	48,0%	58,5%	50,0%	59,5%	69,3%	67,4%	84,0%	83,5%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,519	0,791	0,708	0,677	0,570	0,616	0,470	0,412	0,252	0,019	-0,051
Max 3 Jahre rollierend	115,4%	108,6%	106,8%	110,8%	141,6%	136,3%	139,5%	121,5%	171,3%	148,4%	142,2%
Min 3 Jahre rollierend	-27,5%	-29,9%	-32,0%	-27,2%	-44,7%	-27,1%	-38,6%	-53,7%	-49,4%	-58,9%	-67,7%
Max 5 Jahre rollierend	178,6%	165,3%	177,1%	165,8%	214,3%	230,6%	215,1%	209,4%	270,1%	225,9%	188,3%
Min 5 Jahre rollierend	-21,1%	-22,6%	-18,0%	-14,8%	-38,3%	-18,2%	-43,8%	-48,5%	-55,2%	-71,1%	-72,5%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	60,1%	60,5%	51,6%	56,5%	64,9%	53,6%	49,2%	48,0%	41,9%	44,0%

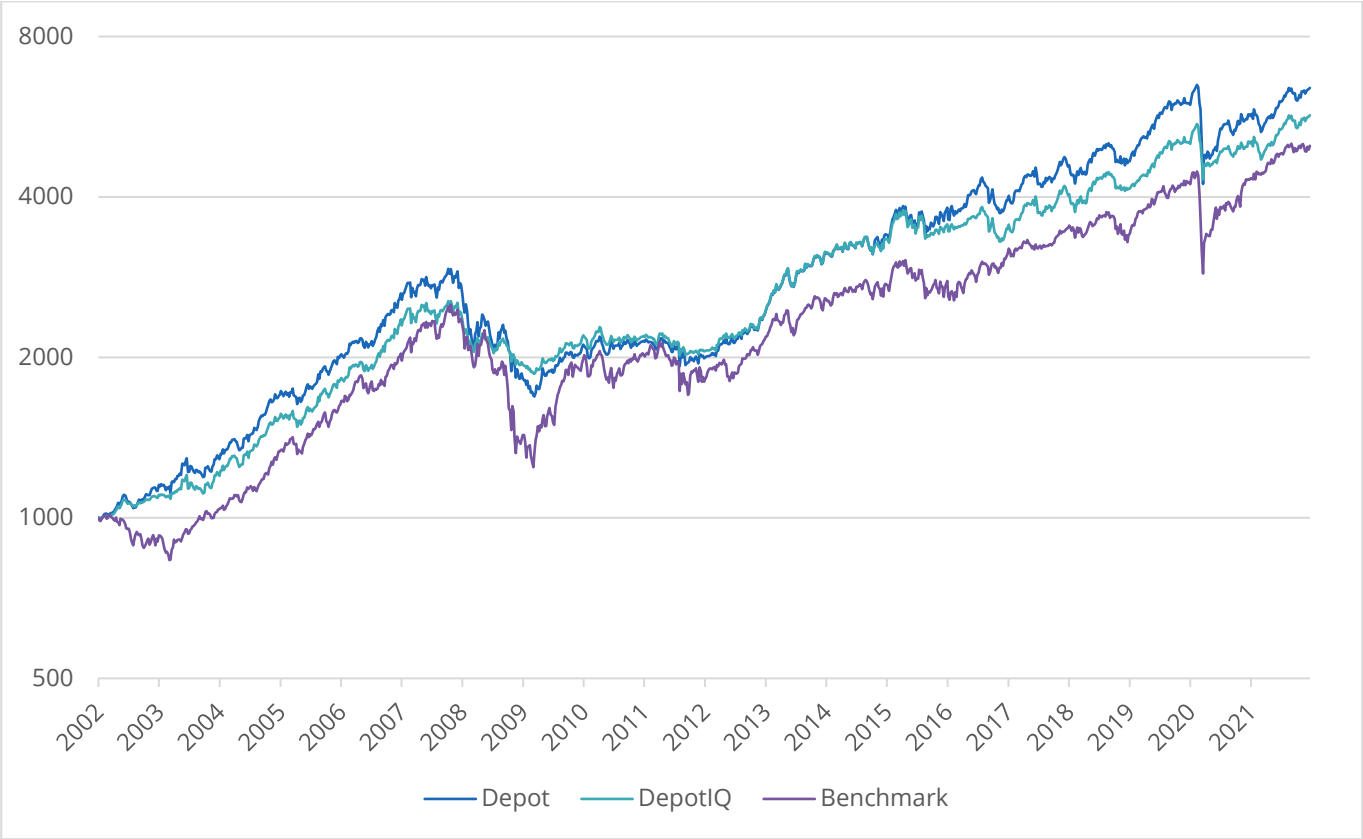


Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	9,7%	9,1%	8,4%
Annualisierte Volatilität	14,2%	11,1%	16,1%
Maximaler Drawdown	42,4%	27,0%	50,5%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,684	0,820	0,519

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Safety	80%
Verkaufskriterium 2	Safety	80%
Depotumschlagsfaktor	0,65	

Max 3 Jahre rollierend	108,9%	100,6%	115,4%
Min 3 Jahre rollierend	-28,5%	-16,5%	-27,5%
Max 5 Jahre rollierend	172,8%	145,5%	178,6%
Min 5 Jahre rollierend	-27,0%	-16,3%	-21,1%
Anteil Outperformance 1 Jahr	55,7%	50,0%	---



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	22,1%	16,7%	-19,8%
30.12.2002	bis	29.12.2003	1,0%	2,1%	6,1%
29.12.2003	bis	27.12.2004	1,5%	4,4%	-2,7%
27.12.2004	bis	26.12.2005	-3,7%	-4,0%	-2,8%
26.12.2005	bis	25.12.2006	5,3%	0,2%	6,0%
25.12.2006	bis	31.12.2007	-11,6%	-9,8%	4,9%
31.12.2007	bis	29.12.2008	8,8%	4,8%	-25,1%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-27,1%	-23,2%	26,1%
28.12.2009	bis	27.12.2010	-1,7%	2,9%	17,2%
27.12.2010	bis	26.12.2011	3,7%	9,5%	-24,6%
26.12.2011	bis	31.12.2012	1,8%	8,3%	-35,3%
31.12.2012	bis	30.12.2013	11,2%	2,8%	-39,9%
30.12.2013	bis	29.12.2014	1,8%	8,3%	-23,6%
29.12.2014	bis	28.12.2015	11,0%	9,7%	-9,1%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-8,3%	-5,4%	33,0%
26.12.2016	bis	25.12.2017	4,3%	0,1%	8,5%
25.12.2017	bis	31.12.2018	4,0%	6,0%	-9,7%
31.12.2018	bis	30.12.2019	2,4%	-2,3%	-10,4%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-5,6%	-1,5%	10,4%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-3,7%	1,8%	-6,4%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	10,1%	17,1%	20,0%	17,2%	19,3%	19,2%	11,6%	19,1%	16,9%	10,1%	-6,0%
27.12.2004	bis	28.12.2009	7,9%	3,5%	2,9%	6,7%	2,3%	8,8%	5,1%	2,4%	7,6%	3,7%	-2,0%
28.12.2009	bis	29.12.2014	7,1%	13,8%	13,1%	12,7%	10,3%	10,0%	2,5%	-1,1%	-11,3%	-16,4%	-14,7%
29.12.2014	bis	30.12.2019	9,2%	12,9%	9,2%	10,1%	7,4%	13,9%	15,1%	12,7%	13,5%	4,5%	15,0%
30.12.2019	bis	27.12.2021	8,1%	4,4%	11,9%	6,6%	13,2%	-3,1%	8,9%	25,2%	10,7%	16,4%	4,2%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	9,7%	9,0%	8,4%	8,3%	9,2%	10,1%	11,2%	11,0%	11,5%	13,4%	18,5%
27.12.2004	bis	28.12.2009	19,7%	15,5%	16,9%	18,5%	18,8%	20,0%	20,0%	27,2%	26,0%	30,0%	34,5%
28.12.2009	bis	29.12.2014	15,4%	10,9%	12,4%	13,1%	15,4%	16,2%	17,5%	19,6%	23,0%	27,5%	31,5%
29.12.2014	bis	30.12.2019	13,1%	12,0%	12,3%	12,6%	13,0%	13,7%	15,0%	15,7%	16,2%	17,8%	23,5%
30.12.2019	bis	27.12.2021	21,7%	18,9%	23,2%	25,4%	22,6%	26,3%	22,9%	25,4%	29,2%	34,3%	33,5%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	17,9%	7,8%	6,1%	6,6%	12,5%	13,7%	25,1%	16,3%	14,5%	31,2%	53,5%
27.12.2004	bis	28.12.2009	50,5%	43,4%	49,1%	48,0%	58,5%	50,0%	59,5%	69,3%	66,0%	69,6%	79,0%
28.12.2009	bis	29.12.2014	20,7%	11,4%	14,0%	15,0%	21,3%	16,3%	26,9%	27,4%	53,0%	70,1%	66,5%
29.12.2014	bis	30.12.2019	16,0%	14,2%	17,5%	13,9%	18,2%	13,3%	13,9%	18,1%	17,5%	30,1%	29,6%
30.12.2019	bis	27.12.2021	35,7%	31,2%	36,9%	43,1%	34,8%	44,4%	39,3%	32,7%	45,5%	49,6%	43,0%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	19,3%	15,5%	10,1%	9,8%	8,4%	9,7%	7,8%	7,8%	17,9%
27.12.2004	bis	28.12.2009	4,3%	7,2%	7,9%	16,2%	12,0%	19,7%	42,4%	27,0%	50,5%
28.12.2009	bis	29.12.2014	10,2%	8,9%	7,1%	11,2%	9,6%	15,4%	12,0%	11,6%	20,7%
29.12.2014	bis	30.12.2019	11,9%	8,6%	9,2%	13,3%	11,8%	13,1%	14,2%	13,9%	16,0%
30.12.2019	bis	27.12.2021	3,4%	6,0%	8,1%	21,6%	13,6%	21,7%	34,8%	21,2%	35,7%

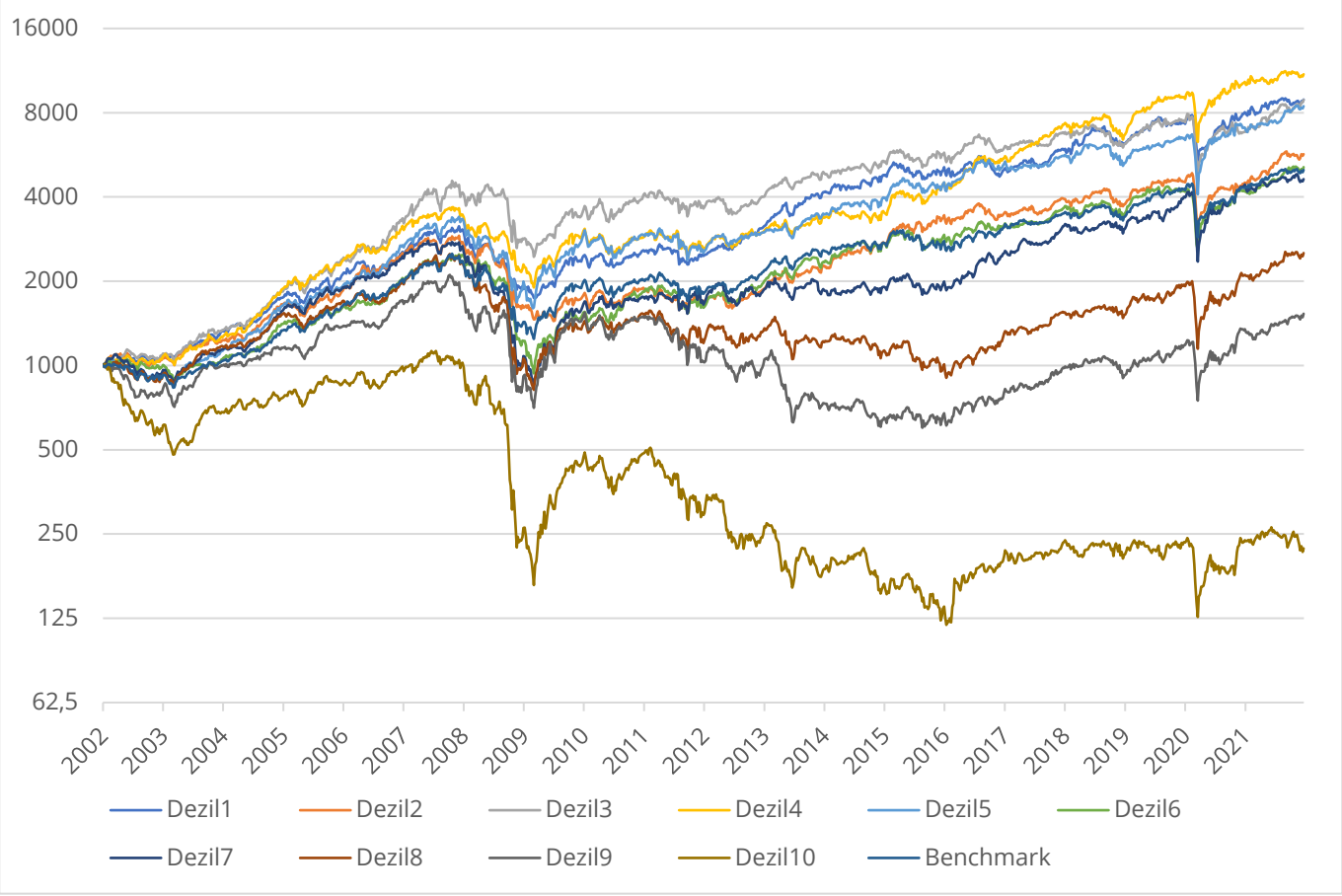
Technischer Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Australien
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	ASX300
Durchschnittliche Anzahl Aktien	192	Scoring-Modell:	Technischer Score

Dezilanalyse

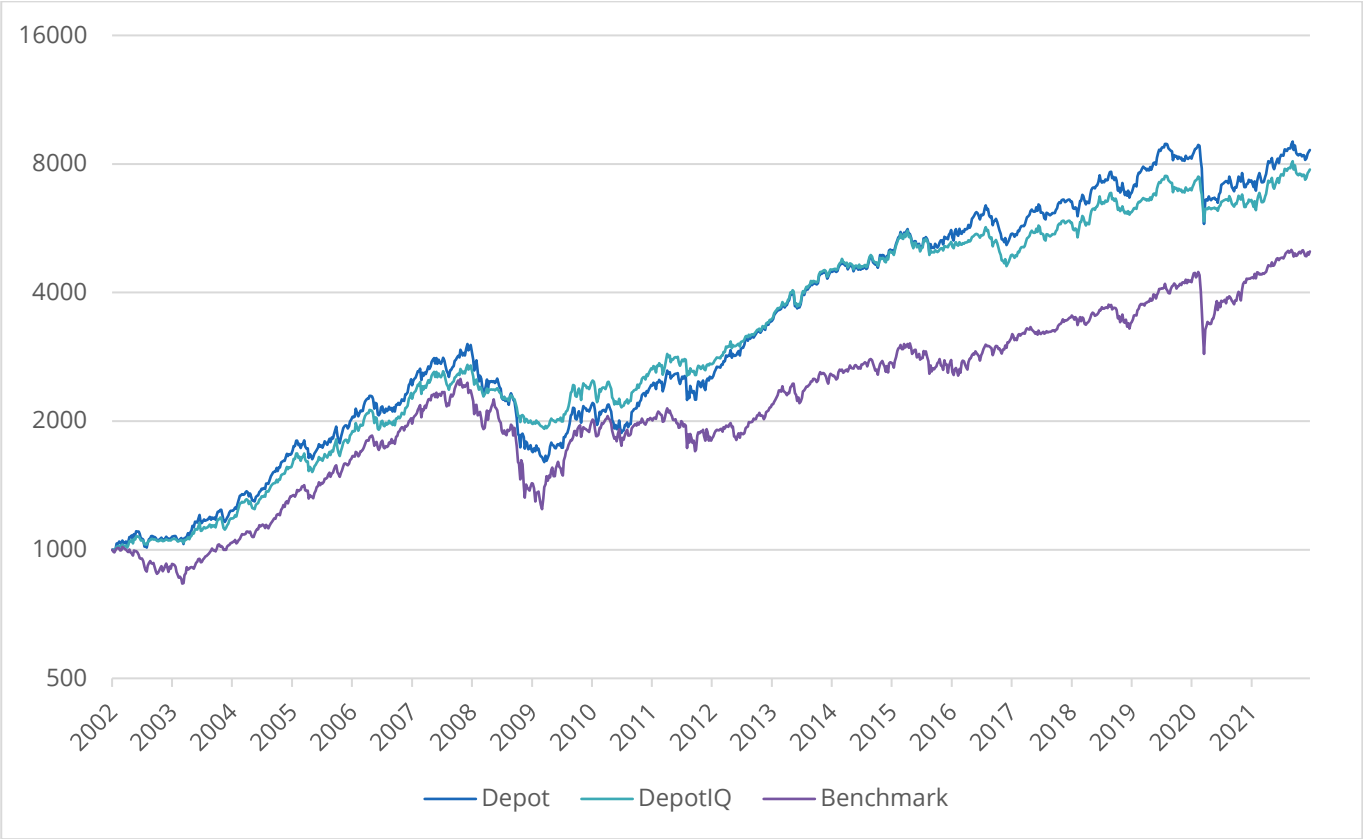
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	8,4%	11,5%	9,1%	11,5%	12,7%	11,2%	8,5%	8,0%	4,7%	2,1%	-7,2%
Annualisierte Volatilität	16,1%	15,1%	16,2%	18,1%	16,8%	17,5%	16,7%	18,5%	20,6%	22,6%	29,2%
Maximaler Drawdown	50,5%	44,5%	50,5%	46,4%	48,4%	53,0%	62,4%	69,3%	67,3%	71,6%	89,5%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,519	0,766	0,560	0,635	0,758	0,641	0,509	0,429	0,229	0,095	-0,248
Max 3 Jahre rollierend	115,4%	120,3%	125,2%	199,9%	160,8%	153,6%	116,2%	143,1%	105,3%	102,4%	110,0%
Min 3 Jahre rollierend	-27,5%	-25,7%	-41,9%	-25,6%	-29,2%	-24,2%	-42,3%	-57,5%	-52,7%	-53,6%	-81,5%
Max 5 Jahre rollierend	178,6%	197,1%	184,8%	325,6%	262,7%	270,2%	162,0%	205,1%	182,4%	167,5%	99,3%
Min 5 Jahre rollierend	-21,1%	-13,3%	-42,8%	-20,5%	-23,2%	-14,5%	-31,0%	-39,2%	-52,4%	-59,0%	-79,5%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	66,9%	50,8%	63,7%	68,6%	62,5%	59,3%	57,3%	45,2%	37,1%	23,4%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	11,4%	10,8%	8,4%
Annualisierte Volatilität	16,1%	12,9%	16,1%
Maximaler Drawdown	47,1%	29,2%	50,5%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,704	0,833	0,519
Max 3 Jahre rollierend	116,4%	109,7%	115,4%
Min 3 Jahre rollierend	-32,6%	-17,1%	-27,5%
Max 5 Jahre rollierend	193,1%	158,0%	178,6%
Min 5 Jahre rollierend	0,8%	8,9%	-21,1%
Anteil Outperformance 1 Jahr	60,5%	56,9%	---

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Technisch	70%
Verkaufskriterium 2	Technisch	70%
Depotumschlagsfaktor	1,55	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	15,7%	15,4%	-21,3%
30.12.2002	bis	29.12.2003	1,6%	6,1%	6,6%
29.12.2003	bis	27.12.2004	6,8%	4,4%	-15,0%
27.12.2004	bis	26.12.2005	-1,9%	-6,2%	-6,2%
26.12.2005	bis	25.12.2006	-1,5%	3,9%	-4,3%
25.12.2006	bis	31.12.2007	5,5%	-1,1%	-12,2%
31.12.2007	bis	29.12.2008	-1,2%	1,7%	-24,2%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-17,0%	-22,1%	40,8%
28.12.2009	bis	27.12.2010	8,0%	1,8%	-0,5%
27.12.2010	bis	26.12.2011	15,4%	3,5%	-24,3%
26.12.2011	bis	31.12.2012	17,2%	0,2%	-27,6%
31.12.2012	bis	30.12.2013	11,4%	7,9%	-45,8%
30.12.2013	bis	29.12.2014	6,1%	11,6%	-19,0%
29.12.2014	bis	28.12.2015	9,5%	13,2%	-6,6%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-15,0%	-11,5%	19,0%
26.12.2016	bis	25.12.2017	9,6%	4,2%	9,5%
25.12.2017	bis	31.12.2018	6,5%	2,8%	-5,4%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-4,3%	-6,2%	-5,8%
30.12.2019	bis	28.12.2020	-13,5%	1,6%	5,8%
28.12.2020	bis	27.12.2021	2,8%	4,3%	-11,4%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	10,1%	20,5%	18,4%	22,7%	23,3%	17,8%	12,0%	16,0%	15,1%	5,0%	-8,7%
27.12.2004	bis	28.12.2009	7,9%	6,9%	1,3%	13,8%	9,6%	11,9%	1,6%	0,8%	-1,8%	5,0%	-9,8%
28.12.2009	bis	29.12.2014	7,1%	14,4%	9,3%	8,8%	3,8%	6,8%	12,4%	3,3%	-4,1%	-15,3%	-18,4%
29.12.2014	bis	30.12.2019	9,2%	9,1%	10,4%	6,9%	20,6%	10,2%	9,0%	15,9%	11,6%	13,0%	7,5%
30.12.2019	bis	27.12.2021	8,1%	9,7%	12,0%	8,8%	9,8%	14,0%	10,2%	7,5%	13,9%	13,8%	-2,6%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	9,7%	9,1%	9,7%	9,4%	10,1%	9,8%	9,0%	10,2%	11,2%	13,4%	18,1%
27.12.2004	bis	28.12.2009	19,7%	17,4%	19,1%	23,4%	18,7%	21,3%	19,9%	22,2%	25,4%	28,2%	35,6%
28.12.2009	bis	29.12.2014	15,4%	13,6%	15,0%	16,0%	17,0%	16,4%	15,9%	17,9%	20,8%	23,7%	30,4%
29.12.2014	bis	30.12.2019	13,1%	13,6%	13,3%	13,2%	13,9%	13,4%	13,1%	13,5%	15,5%	16,5%	24,1%
30.12.2019	bis	27.12.2021	21,7%	21,6%	23,8%	26,7%	24,0%	26,0%	24,6%	28,2%	28,1%	27,6%	33,5%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	17,9%	6,3%	10,7%	9,3%	8,5%	18,0%	15,2%	20,8%	18,3%	29,3%	52,4%
27.12.2004	bis	28.12.2009	50,5%	44,5%	50,5%	46,4%	48,4%	53,0%	62,4%	69,3%	67,3%	66,5%	85,5%
28.12.2009	bis	29.12.2014	20,7%	15,3%	16,7%	19,2%	21,5%	23,0%	20,1%	16,7%	33,1%	60,9%	69,8%
29.12.2014	bis	30.12.2019	16,0%	15,6%	13,6%	17,0%	18,8%	16,2%	14,3%	15,9%	25,9%	16,4%	34,2%
30.12.2019	bis	27.12.2021	35,7%	34,0%	39,9%	42,3%	33,5%	39,0%	39,3%	43,7%	42,7%	39,2%	47,8%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	18,8%	16,0%	10,1%	10,0%	8,3%	9,7%	8,4%	6,4%	17,9%
27.12.2004	bis	28.12.2009	5,1%	9,2%	7,9%	18,0%	14,3%	19,7%	47,1%	29,2%	50,5%
28.12.2009	bis	29.12.2014	18,6%	15,5%	7,1%	15,3%	12,6%	15,4%	14,9%	13,6%	20,7%
29.12.2014	bis	30.12.2019	10,5%	7,0%	9,2%	14,2%	12,3%	13,1%	19,2%	19,0%	16,0%
30.12.2019	bis	27.12.2021	1,9%	5,2%	8,1%	23,7%	16,8%	21,7%	34,6%	21,4%	35,7%

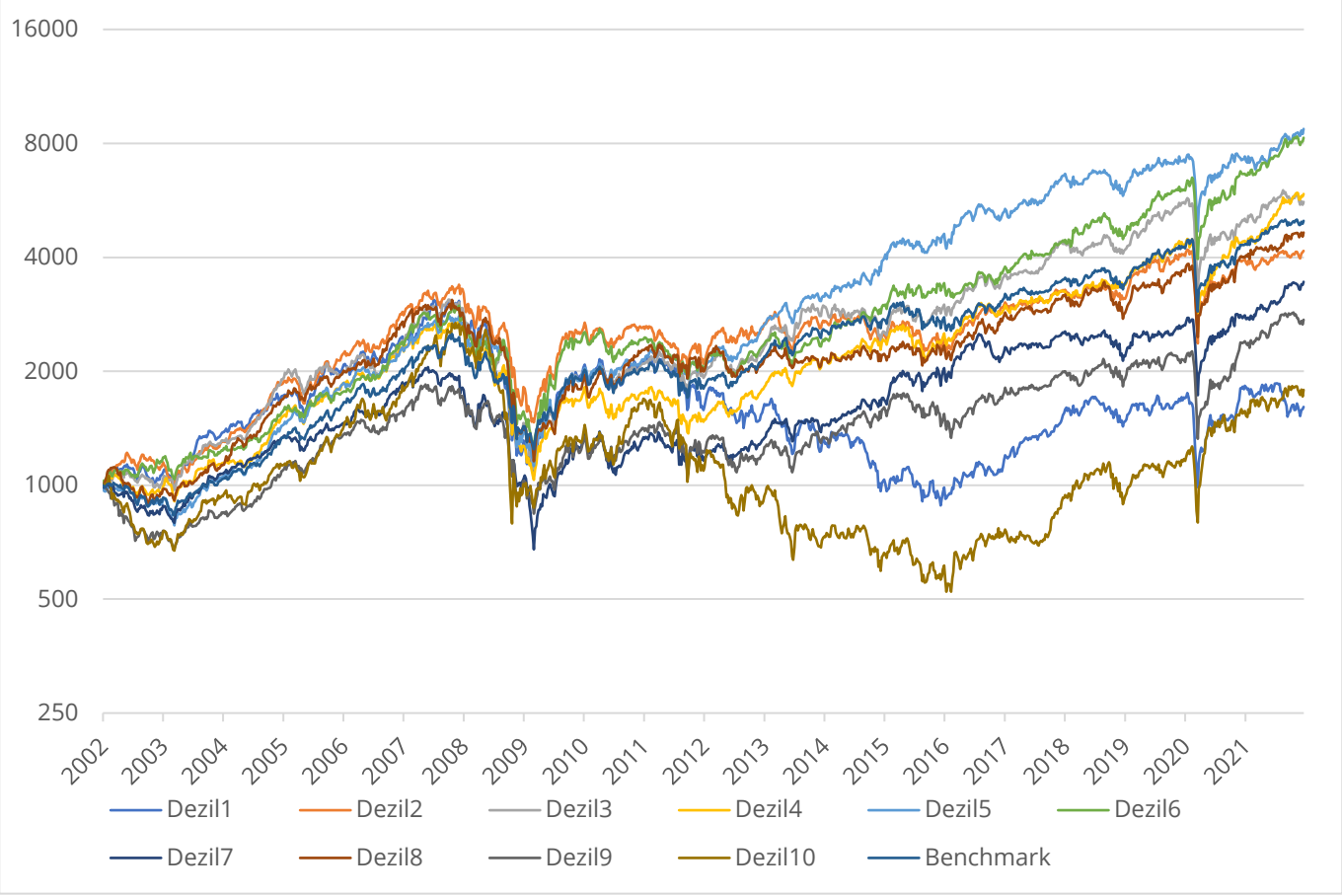
Value-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Australien
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	ASX300
Durchschnittliche Anzahl Aktien	178	Scoring-Modell:	Value-Score

Dezilanalyse

	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	8,4%	2,4%	7,4%	9,0%	9,2%	11,4%	11,1%	6,4%	8,0%	5,2%	2,9%
Annualisierte Volatilität	16,1%	20,9%	18,3%	18,0%	17,5%	17,6%	17,9%	18,0%	18,2%	19,4%	26,5%
Maximaler Drawdown	50,5%	71,4%	56,8%	64,3%	61,9%	59,8%	57,3%	67,1%	62,5%	54,4%	80,5%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,519	0,115	0,402	0,501	0,529	0,648	0,621	0,354	0,437	0,265	0,111
Max 3 Jahre rollierend	115,4%	105,6%	133,6%	119,3%	131,7%	146,2%	130,2%	96,1%	140,1%	113,1%	151,2%
Min 3 Jahre rollierend	-27,5%	-47,4%	-37,1%	-47,9%	-46,5%	-41,8%	-30,9%	-56,7%	-43,1%	-40,9%	-58,4%
Max 5 Jahre rollierend	178,6%	198,8%	208,4%	209,5%	183,2%	214,9%	174,8%	136,4%	233,5%	155,3%	285,0%
Min 5 Jahre rollierend	-21,1%	-58,1%	-26,4%	-32,4%	-41,1%	-20,8%	-30,4%	-42,1%	-34,5%	-40,2%	-70,7%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	42,3%	39,5%	58,1%	53,6%	67,7%	56,9%	37,5%	51,6%	41,5%	42,3%

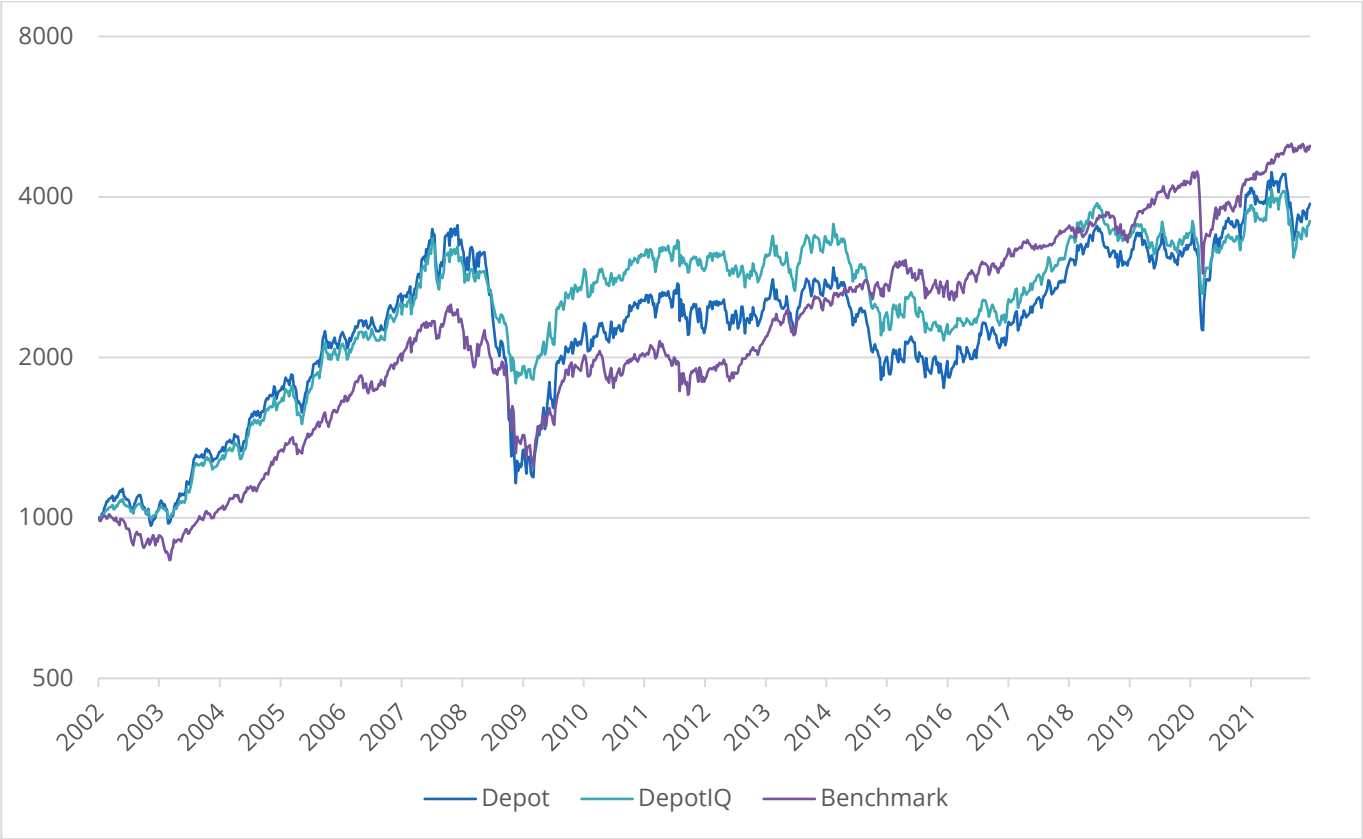


Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	7,0%	6,6%	8,4%
Annualisierte Volatilität	22,3%	17,7%	16,1%
Maximaler Drawdown	67,2%	46,4%	50,5%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,314	0,373	0,519

Max 3 Jahre rollierend	129,7%	128,3%	115,4%
Min 3 Jahre rollierend	-46,7%	-32,8%	-27,5%
Max 5 Jahre rollierend	258,2%	220,4%	178,6%
Min 5 Jahre rollierend	-33,6%	-31,1%	-21,1%
Anteil Outperformance 1 Jahr	55,7%	54,0%	---

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Value	90%
Verkaufskriterium 2	Value	90%
Depotumschlagsfaktor	0,99	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	12,5%	18,8%	-17,0%
30.12.2002	bis	29.12.2003	12,8%	7,8%	7,0%
29.12.2003	bis	27.12.2004	3,1%	5,0%	-4,0%
27.12.2004	bis	26.12.2005	1,8%	-3,8%	1,5%
26.12.2005	bis	25.12.2006	-1,6%	1,7%	-2,6%
25.12.2006	bis	31.12.2007	10,0%	-0,7%	12,4%
31.12.2007	bis	29.12.2008	-21,7%	-12,6%	-12,5%
29.12.2008	bis	28.12.2009	34,1%	18,4%	-5,0%
28.12.2009	bis	27.12.2010	13,3%	-0,6%	13,0%
27.12.2010	bis	26.12.2011	-1,4%	-10,6%	-12,4%
26.12.2011	bis	31.12.2012	-5,5%	-7,2%	-28,2%
31.12.2012	bis	30.12.2013	-9,6%	-26,5%	-24,1%
30.12.2013	bis	29.12.2014	-35,6%	-21,6%	-2,1%
29.12.2014	bis	28.12.2015	-4,1%	-5,5%	-6,8%
28.12.2015	bis	26.12.2016	0,7%	7,2%	6,0%
26.12.2016	bis	25.12.2017	23,6%	11,5%	8,0%
25.12.2017	bis	31.12.2018	6,6%	-1,6%	-0,7%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-19,2%	-2,5%	-4,8%
30.12.2019	bis	28.12.2020	23,9%	-0,2%	21,1%
28.12.2020	bis	27.12.2021	-20,1%	-18,1%	-1,1%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	10,1%	19,9%	22,8%	24,1%	14,8%	12,9%	15,9%	10,2%	19,1%	2,9%	4,2%
27.12.2004	bis	28.12.2009	7,9%	3,0%	6,8%	0,5%	2,8%	6,5%	9,7%	-0,4%	2,0%	3,3%	3,2%
28.12.2009	bis	29.12.2014	7,1%	-12,4%	-0,6%	5,4%	6,9%	14,8%	3,9%	5,4%	3,6%	4,4%	-13,1%
29.12.2014	bis	30.12.2019	9,2%	10,7%	10,2%	17,0%	12,2%	12,9%	15,0%	9,2%	10,8%	6,1%	12,3%
30.12.2019	bis	27.12.2021	8,1%	-2,9%	1,0%	0,1%	16,6%	9,8%	17,2%	14,1%	12,1%	13,0%	23,4%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	9,7%	10,9%	10,7%	10,7%	11,1%	11,1%	10,8%	10,7%	12,0%	12,8%	14,5%
27.12.2004	bis	28.12.2009	19,7%	24,6%	22,4%	22,3%	20,7%	22,9%	23,2%	21,7%	22,0%	21,7%	32,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	15,4%	21,7%	16,9%	17,1%	16,2%	14,8%	15,1%	17,3%	17,8%	20,7%	28,0%
29.12.2014	bis	30.12.2019	13,1%	16,3%	13,9%	12,5%	12,9%	14,0%	14,0%	15,1%	14,8%	15,8%	20,3%
30.12.2019	bis	27.12.2021	21,7%	28,7%	27,2%	26,3%	27,0%	24,3%	25,5%	24,2%	23,7%	25,7%	31,5%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	17,9%	11,2%	18,3%	10,9%	15,7%	21,6%	13,0%	20,9%	20,7%	32,4%	36,6%
27.12.2004	bis	28.12.2009	50,5%	65,0%	56,8%	64,3%	61,9%	59,8%	57,3%	67,1%	62,5%	54,4%	70,5%
28.12.2009	bis	29.12.2014	20,7%	56,0%	23,8%	20,7%	24,7%	18,1%	26,0%	23,1%	18,6%	27,5%	64,9%
29.12.2014	bis	30.12.2019	16,0%	20,9%	17,6%	11,6%	18,7%	14,5%	14,6%	16,8%	20,2%	23,8%	27,7%
30.12.2019	bis	27.12.2021	35,7%	43,7%	43,5%	44,3%	43,2%	37,3%	39,1%	37,6%	36,0%	41,3%	37,1%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	20,1%	18,2%	10,1%	12,6%	9,9%	9,7%	14,8%	8,3%	17,9%
27.12.2004	bis	28.12.2009	4,7%	10,7%	7,9%	27,5%	19,9%	19,7%	67,2%	46,4%	50,5%
28.12.2009	bis	29.12.2014	-1,8%	-2,6%	7,1%	22,5%	18,9%	15,4%	38,4%	38,2%	20,7%
29.12.2014	bis	30.12.2019	10,4%	7,3%	9,2%	18,5%	15,8%	13,1%	19,8%	19,8%	16,0%
30.12.2019	bis	27.12.2021	9,3%	2,7%	8,1%	27,3%	22,3%	21,7%	34,4%	27,0%	35,7%

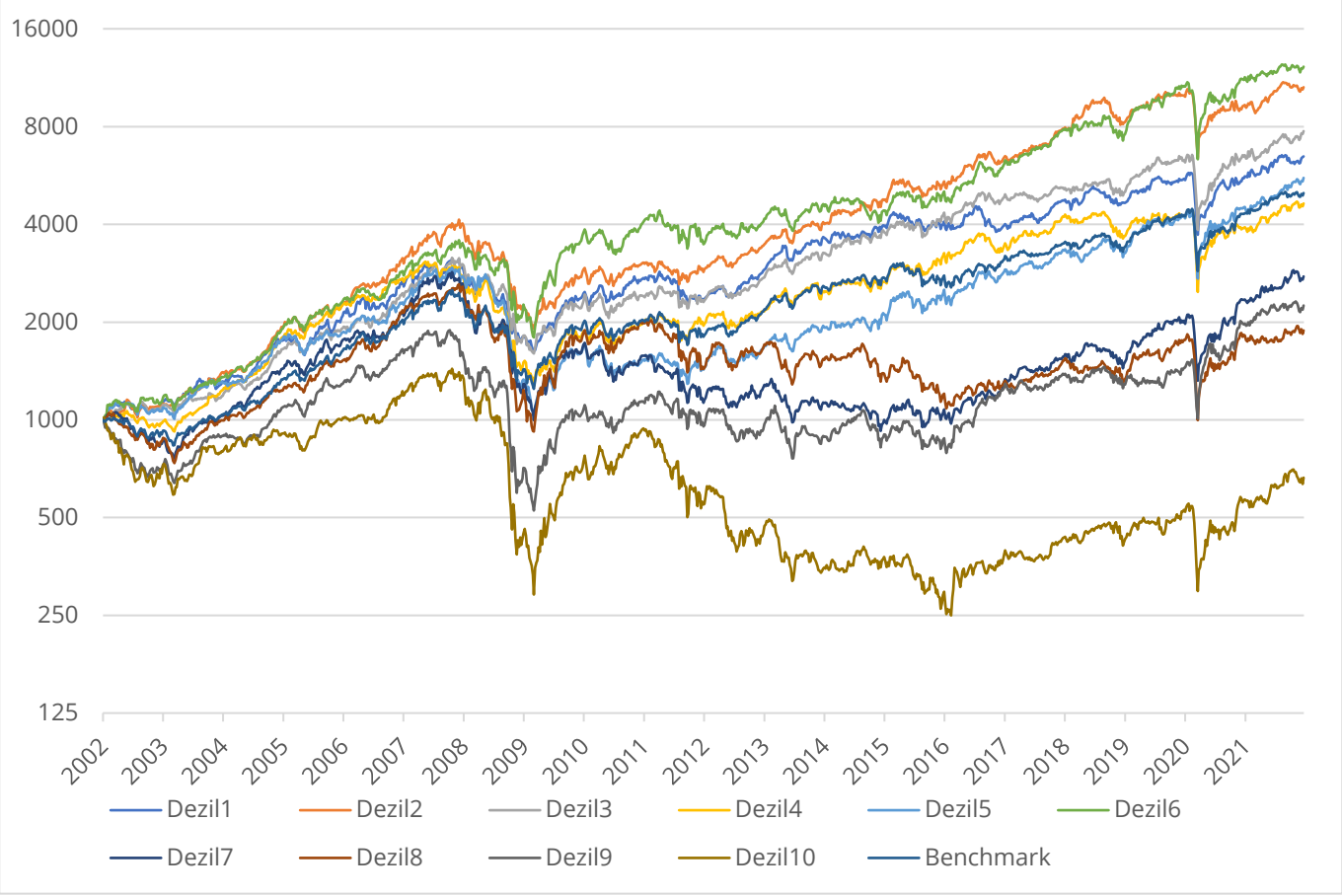
Kombi-Score

Strategiespezifikationen

Beginn der Analyse	07.01.2002	Region:	Australien
Ende der Analyse	27.12.2021	Benchmark:	ASX300
Durchschnittliche Anzahl Aktien	178	Scoring-Modell:	Kombi-Score

Dezilanalyse

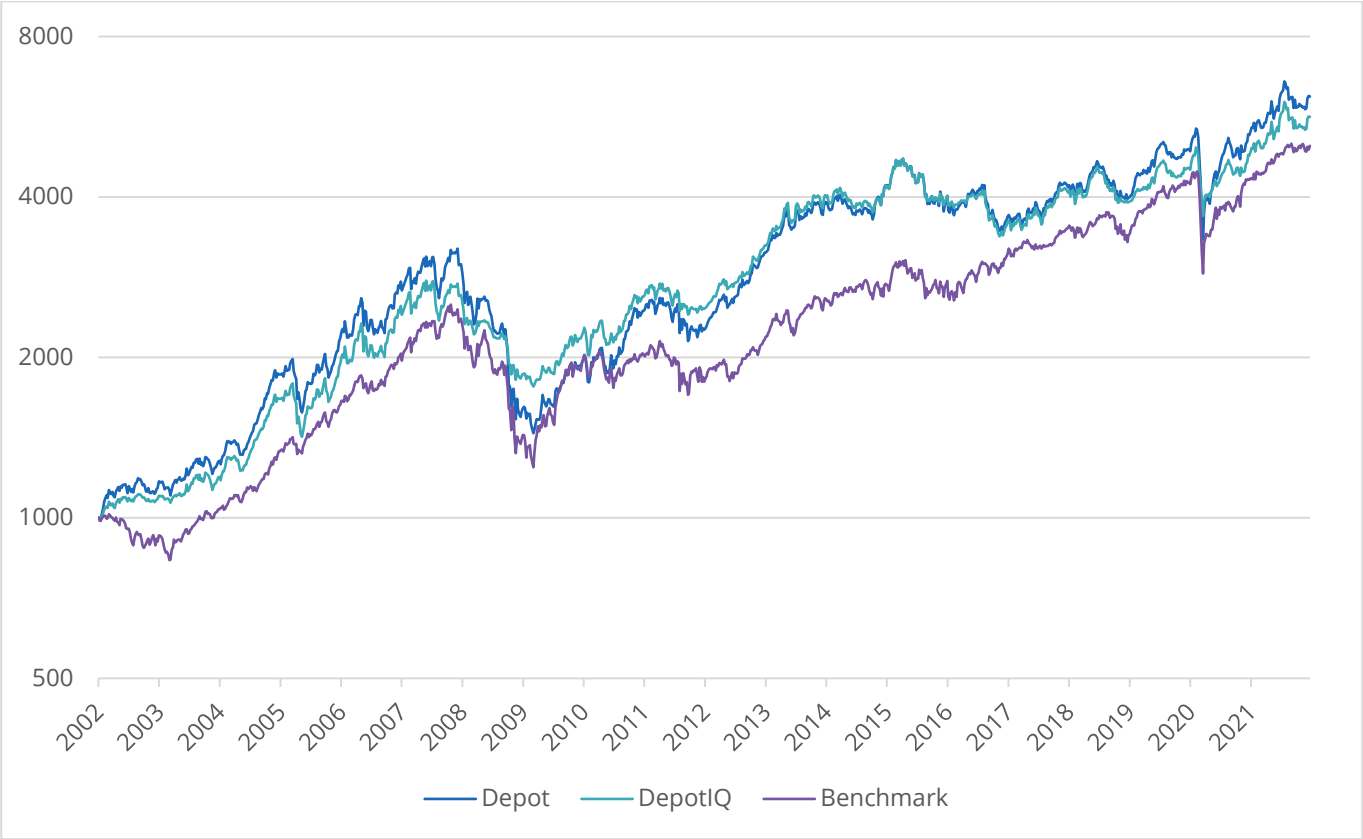
	Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
Annualisierte Rendite	8,4%	9,8%	12,5%	10,8%	8,0%	8,9%	13,3%	5,2%	3,2%	4,1%	-2,0%
Annualisierte Volatilität	16,1%	15,7%	15,8%	16,5%	17,2%	17,7%	18,9%	19,3%	20,6%	22,3%	27,8%
Maximaler Drawdown	50,5%	48,3%	53,9%	49,3%	58,8%	65,0%	49,8%	67,5%	64,8%	72,2%	82,6%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,519	0,622	0,790	0,650	0,464	0,504	0,703	0,269	0,156	0,185	-0,073
Max 3 Jahre rollierend	115,4%	129,8%	154,5%	126,8%	153,3%	112,8%	129,5%	142,4%	136,8%	116,9%	112,1%
Min 3 Jahre rollierend	-27,5%	-24,7%	-31,9%	-27,8%	-45,6%	-52,5%	-25,3%	-52,3%	-44,3%	-61,9%	-71,4%
Max 5 Jahre rollierend	178,6%	190,4%	276,6%	193,2%	210,6%	176,5%	220,4%	231,2%	214,5%	179,2%	124,6%
Min 5 Jahre rollierend	-21,1%	-19,8%	-20,6%	-19,9%	-36,4%	-48,8%	9,6%	-59,8%	-45,9%	-53,4%	-72,5%
Anteil Outperformance 1 Jahr	---	56,9%	63,3%	57,3%	45,2%	55,2%	70,6%	46,0%	36,3%	38,7%	36,7%



Depotanalyse

	Depot	Depot IQ	Benchmark
Annualisierte Rendite	9,5%	9,0%	8,4%
Annualisierte Volatilität	17,7%	14,3%	16,1%
Maximaler Drawdown	55,0%	36,7%	50,5%
Rendite-Risiko-Verhältnis	0,538	0,629	0,519
Max 3 Jahre rollierend	133,3%	125,0%	115,4%
Min 3 Jahre rollierend	-39,1%	-23,7%	-27,5%
Max 5 Jahre rollierend	187,2%	158,6%	178,6%
Min 5 Jahre rollierend	-27,5%	-19,5%	-21,1%
Anteil Outperformance 1 Jahr	50,4%	50,8%	---

Anzahl Aktien im Depot	10	
Verkaufskriterium 1	Kombi	70%
Verkaufskriterium 2	Kombi	70%
Depotumschlagsfaktor	1,27	



Vergleich einzelner Jahre

Zeitraum			Depot vs. Benchmark	Dezil 1 & 2 vs. Benchmark	Dezil 9 & 10 vs. Benchmark
07.01.2002	bis	30.12.2002	23,6%	20,4%	-20,8%
30.12.2002	bis	29.12.2003	-2,9%	6,9%	6,9%
29.12.2003	bis	27.12.2004	17,3%	8,1%	-11,0%
27.12.2004	bis	26.12.2005	-6,2%	-4,7%	-7,3%
26.12.2005	bis	25.12.2006	1,8%	8,8%	-0,7%
25.12.2006	bis	31.12.2007	-6,9%	3,8%	-11,0%
31.12.2007	bis	29.12.2008	-6,5%	-1,3%	-23,2%
29.12.2008	bis	28.12.2009	-15,3%	-8,3%	23,7%
28.12.2009	bis	27.12.2010	20,5%	5,1%	15,3%
27.12.2010	bis	26.12.2011	2,5%	1,3%	-17,3%
26.12.2011	bis	31.12.2012	21,4%	2,4%	-29,9%
31.12.2012	bis	30.12.2013	4,7%	3,0%	-33,0%
30.12.2013	bis	29.12.2014	1,1%	6,8%	-3,4%
29.12.2014	bis	28.12.2015	-6,5%	6,2%	-12,0%
28.12.2015	bis	26.12.2016	-20,7%	-4,0%	22,6%
26.12.2016	bis	25.12.2017	3,4%	9,6%	1,8%
25.12.2017	bis	31.12.2018	-2,4%	4,2%	-2,3%
31.12.2018	bis	30.12.2019	-2,5%	-6,1%	-6,8%
30.12.2019	bis	28.12.2020	5,3%	-4,2%	20,7%
28.12.2020	bis	27.12.2021	2,3%	-0,5%	0,0%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Dezile

Annualisierte Rendite			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	10,1%	20,8%	24,7%	18,2%	21,5%	20,9%	24,0%	12,9%	7,2%	2,8%	-3,2%
27.12.2004	bis	28.12.2009	7,9%	6,5%	8,2%	6,6%	0,7%	-1,4%	14,2%	3,0%	8,0%	-0,6%	-4,7%
28.12.2009	bis	29.12.2014	7,1%	10,5%	10,8%	11,0%	7,6%	5,3%	3,6%	-10,0%	-5,1%	-3,5%	-12,1%
29.12.2014	bis	30.12.2019	9,2%	6,8%	15,8%	10,4%	9,7%	14,7%	19,3%	15,6%	4,8%	10,3%	7,2%
30.12.2019	bis	27.12.2021	8,1%	8,3%	2,9%	10,8%	4,6%	14,4%	7,1%	17,0%	3,4%	24,8%	12,1%

Annualisierte Volatilität			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	9,7%	9,7%	9,4%	8,7%	9,5%	9,7%	11,7%	11,7%	11,7%	13,6%	18,1%
27.12.2004	bis	28.12.2009	19,7%	19,5%	19,4%	19,5%	20,2%	20,4%	22,7%	23,3%	24,6%	28,9%	33,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	15,4%	14,9%	14,0%	14,9%	15,5%	17,4%	18,1%	19,4%	20,7%	21,6%	29,0%
29.12.2014	bis	30.12.2019	13,1%	12,4%	13,0%	12,7%	13,5%	14,8%	14,6%	15,5%	15,9%	16,9%	22,1%
30.12.2019	bis	27.12.2021	21,7%	21,1%	22,8%	27,0%	27,4%	25,7%	27,3%	25,3%	28,9%	27,3%	32,8%

Maximaler Drawdown			Benchmark	Dezil 1	Dezil 2	Dezil 3	Dezil 4	Dezil 5	Dezil 6	Dezil 7	Dezil 8	Dezil 9	Dezil 10
07.01.2002	bis	27.12.2004	17,9%	7,2%	11,8%	8,3%	13,7%	10,9%	10,1%	28,1%	29,9%	36,1%	42,2%
27.12.2004	bis	28.12.2009	50,5%	48,3%	53,9%	49,3%	58,8%	65,0%	49,8%	65,0%	64,8%	72,2%	79,9%
28.12.2009	bis	29.12.2014	20,7%	20,5%	15,0%	15,8%	18,5%	24,9%	23,8%	46,5%	36,6%	37,7%	66,2%
29.12.2014	bis	30.12.2019	16,0%	16,7%	17,5%	11,1%	17,2%	14,2%	16,3%	17,7%	30,0%	20,3%	35,1%
30.12.2019	bis	27.12.2021	35,7%	35,5%	38,3%	41,3%	44,1%	38,2%	42,1%	37,3%	45,6%	34,2%	46,2%

Vergleich 5-Jahres-Zeiträume Depot

Zeitraum			Annualisierte Rendite			Annualisierte Volatilität			Maximaler Drawdown		
			Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark	Depot	Depot IQ	Benchmark
07.01.2002	bis	27.12.2004	23,1%	18,9%	10,1%	10,8%	8,9%	9,7%	7,2%	7,2%	17,9%
27.12.2004	bis	28.12.2009	1,0%	5,6%	7,9%	22,1%	17,8%	19,7%	55,0%	36,7%	50,5%
28.12.2009	bis	29.12.2014	16,5%	13,7%	7,1%	16,0%	13,5%	15,4%	17,0%	12,6%	20,7%
29.12.2014	bis	30.12.2019	3,2%	1,5%	9,2%	14,2%	12,3%	13,1%	26,8%	28,4%	16,0%
30.12.2019	bis	27.12.2021	12,0%	11,6%	8,1%	24,4%	17,8%	21,7%	38,1%	25,7%	35,7%