

**TGA@GLOBEX TECH**

**CORE 100 NQ**

Auswertungen und Kommentar

FY 2022

INVESTOR  GUARD

Jansen Thomas

Finanzanalysen und Anlageempfehlungen

Schützenstr. 10A

D-47906 Kempen

# — — **Balanced Setup**

## **Full Year / 2022**

Alle Ergebnisse basieren auf der Kernlogik Trend-Guard Assistance, die im Balanced Setup berechnet wurde.

Timeframe: Tagesbasis und 8H Intraday

Algorithmus: Core

Ausführung: Balkenschluss Signalbalken (Entry und Exit und TP)

Berichtsperiode: 01.01.2022 - 31.12.2022 geschlossene Positionen

Anlagebetrag: 652.000,00 USD (Kontraktwert x2 NQ per 31.12.2021)

Maximaler Hebel: 2.0

1. Roh > exklusive Kosten und Slippage
2. Trades > geschlossene Handlungen
3. Trefferquote > Anteil der Gewinnerhandlungen
4. Drawdown > maximaler Gegenlauf OTE + Settled per EOY

Die Funktion der Kernlogik umfasst das Ausspielen eines mathematischen Entry- und Exitsignals. Zusätzliche Assistenzsysteme wie Basis- und Trailingstopps oder die Zielerfassung sind teilweise aufgeschaltet und fließen mit in die Ergebnisse ein. Es handelt sich daher um Ergebnisse, die für alle Assets die selben Grundvoraussetzungen liefern und damit einen repräsentativen und objektiven Blick auf Trend-Guard Assistance ermöglichen.

---

## Trend-Guard Algorithmus 2x (Basis Setup / no stops / multiple targets)

| SETUP DAILY 2022  | Roh %     | Trades    | Trefferquote | Drawdown  |
|-------------------|-----------|-----------|--------------|-----------|
| NQ1! DAILY        | 20,08%    | 11        | 63,64%       | 6,35%     |
| SETUP ID 8H 2022  | Roh %     | Trades    | Trefferquote | Drawdown  |
| NQ1! 8H           | 24,98%    | 37        | 70,27        | 13,73%    |
| Position          | NQ D      | NQ 8H     | Gesamt       | % to Base |
| Handelsertrag USD | 64.465,00 | 81.420,00 | 146.885,00   | 22,53%    |

| Produktkalkulation       | USD        | % to Base | 5M Base USD  | 5M %    |
|--------------------------|------------|-----------|--------------|---------|
| Handelsertrag Gesamt USD | 146.885,00 | 22,53%    | 1.126.418,71 | 22,53%  |
| Base USD                 | 652.000,00 | 100,00%   | 5.000.000,00 | 100,00% |
| MA Fee (2%)              | 13.040,00  | 2,00%     | 100.000,00   | 2,00%   |
| Net MA Fee               | 785.845,00 | 120,53%   | 6.026.418,71 | 120,53% |
| PS Base                  | 133.845,00 | 20,53%    | 1.026.418,71 | 20,53%  |
| PS Share                 | 26.769,00  | 4,11%     | 205.283,74   | 4,11%   |
| Ertrag nach allen Kosten | 107.076,00 | 16,42%    | 821.134,97   | 16,42%  |
| Umsatz Manager           | -          | -         | 275.283,74   | 5,51%   |

per 31.12.2022

## — — Kommentar

### Full Year / 2022

Das Jahr 2023 hat mit einer guten Performance i.H. 16,42% nach MA-Fee und PS-Share abgeschlossen. Slippage oder Handelsspesen wurden im Transaktionsmanagement nicht berücksichtigt.

Nach internem Abzug der TGA-Lizenzkosten (hier: Mindestgebühr USD 30.000,00 p.a.) verblieb dem Manager ein Umsatz i.H.v. USD 275.283,74 (5,51% auf USD 5.000.000,00). Weitere Kosten wie Fonds- oder Zertifikatskosten sind hier nicht berücksichtigt.

Das Instrument konnte in beiden Zeiteinheiten profitabel agieren.

Die Trefferquote der Einzelempfehlungen war akzeptabel. Die jeweiligen Programmdrawdowns lagen innerhalb des Toleranzbereichs.

Operative Umsetzungsprobleme im Transaktionsmanagement sind bei Prüfung der Signaltrades nicht auffällig geworden.

Anmerkung:

Es handelt sich um nicht optimierte Kerndaten, die keinerlei Entscheidungsspielraum des Managers im Transaktionsmanagement erfordern. Alle Zielpunkte können bei Signalgenerierung installiert werden. Die TP-Exit-Logik schließt den Trade bei Erreichen des TP-Punktes per Balkenschlusskurs.

Im Falle eines gegenläufigen Signals werden Exit-Signale generiert, die im Rahmen des Investmentprozesses manuell überwacht und diskretionär umgesetzt werden müssen.

# ANFRAGE



— —  
**Thomas Jansen**  
**+49 (0) 2152 957 50 70**  
**+49 (0) 172 64 84 368**  
**[t.jansen@investor-guard.com](mailto:t.jansen@investor-guard.com)**