

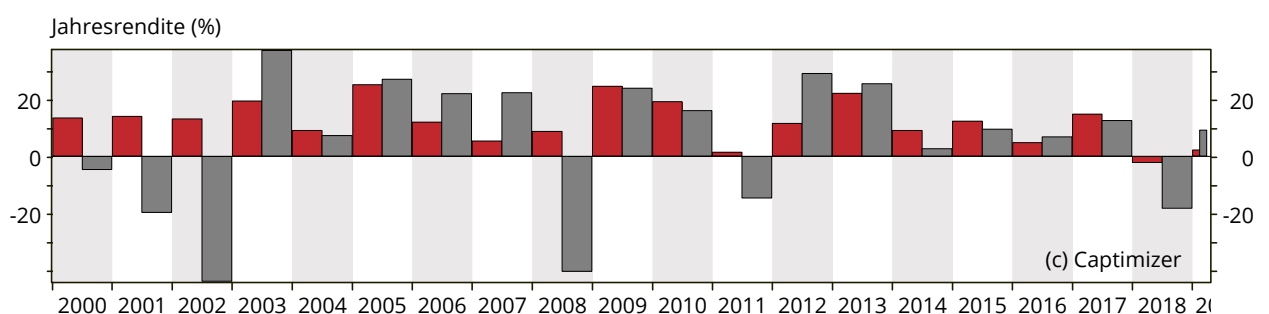
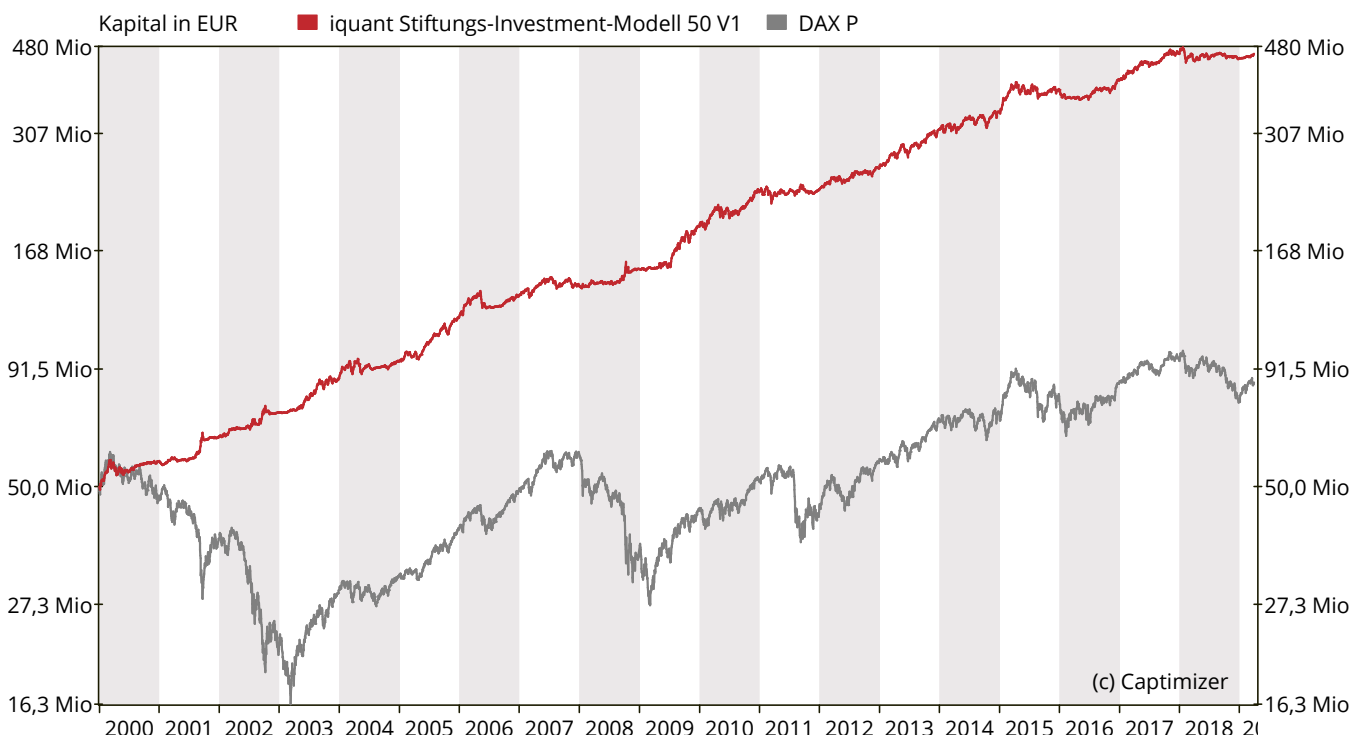
iquant Stiftungs-Investment-Modell 50 V1

| Basisdaten | | Beschreibung | |
|----------------------------|---------------------|--|--|
| Outperformance | 754 % (9,43 % p.a.) | Das Modell wurde für ein Anlagevolumen von 50 Mio. Euro konzipiert und verteilt das Anlagekapital auf acht Subsysteme, die sich aus mehreren Strategien zusammensetzen. Es werden insgesamt 25 Strategien eingesetzt. Jede Strategie investiert in 5-10 Aktien oder in 1-5 ETFs um eine ausreichende Diversifikation zu erreichen. | |
| Transaktionen | 2759 (143,3 p.a.) | | |
| Benchmark | DAX P | | |
| | Benchmark | Strategie | |
| Kapital | | | |
| Start 01/2000 | 50.000.000 EUR | 50.000.000 EUR | |
| Ende 03/2019 | 85.368.462 EUR | 462.144.647 EUR | |
| Rendite | | | |
| Rendite p.a. (geo.) | 2,82 % | 12,25 % | |
| Rendite 2018 | -18,26 % | -2,20 % | |
| Rendite 2019 YTD | 9,16 % | 2,27 % | |
| Risiko | | | |
| Maximaler Rückgang | -72,68 % | -8,59 % | |
| Mittlerer Rückgang | -23,21 % | -2,34 % | |
| Volatilität p.a. | 20,50 % | 7,20 % | |
| Längste Verlustperiode | 7,31 J. | 1,69 J. | |
| Rendite zu Risiko | | | |
| Rendite / Max. Rückgang | 0,04 | 1,43 | |
| Rendite / Mittel Rückgang | 0,12 | 5,24 | |
| Rendite / Volatilität p.a. | 0,14 | 1,70 | |

Subsysteme:

1. Dividende D + US (15%)
2. Relative Stärke Deutschland (10%)
3. Trendfolge Deutschland (10%)
4. Trendfolge Global (10%)
5. Trendfolge Renten Deutschland (20%)
6. Saisonal Deutschland (10%)
7. Technologie-Mix (NASDAQ100) (10%)
8. Branchenrotation Europa (10%)

Bei der Simulation der Anlageergebnisse wurden eine Managementgebühr von 0,5% p.a. und Transaktionskosten von 0,1% je Kauf und je Verkauf berücksichtigt. Die Gebühren der Ziel-ETFs würden mit den aktuellen Werten ebenfalls in der Berechnung berücksichtigt. Die Liquidität wird im Geldmarkt zum Eonia-Geldmarktsatz angelegt.



iquant Stiftungs-Investment-Modell 50 V1

| | | |
|-------------------------|---------|--------|
| Chance | | 3,0 |
| Rendite p.a. | 12,25 % | 3,0 |
| Outperformance p.a. | 9,43 % | 5,0 |
| positive Monatsrenditen | 68,83 % | 4,5 |
| Risiko | | 1,5 |
| Maximaler Rückgang | -8,59 % | 1,5 |
| Mittlerer Rückgang | -2,34 % | 0,0 |
| Max. Verlustdauer | 1,69 J. | 1,5 |
| Volatilität p.a. | 7,20 % | 1,0 |
| Bequemlichkeit | | 1,0 |
| Transaktionen p.a. | 283,15 | 1,0 |
| Handelstage p.a. | 118,11 | 2,0 |
| Anlagehorizont | | 3Jahre |
| Max. Verlustdauer | 1,69 J. | |

Max. Transaktionen im Kalenderjahr 547 (2000)

iquant Stiftungs-Investment-Modell 50 V1

| | Jahresrenditen (%) | Monatsrenditen (%) | | | | | | | | | | | |
|------------|--------------------|--------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| | | Jan | Feb | Mär | Apr | Mai | Jun | Jul | Aug | Sep | Okt | Nov | Dez |
| 2000 | 13,41 | 3,00 | 8,84 | -0,61 | -1,62 | -2,23 | 0,79 | 1,49 | 1,93 | 0,87 | -0,02 | 1,15 | -0,51 |
| 2001 | 13,98 | -1,23 | 2,03 | 0,95 | -1,11 | 0,56 | 0,43 | 0,37 | 3,36 | 6,24 | 0,87 | 0,20 | 0,70 |
| 2002 | 13,08 | 1,37 | 0,88 | 2,09 | 0,08 | -0,48 | 0,59 | 2,44 | -0,79 | 8,24 | -1,47 | -0,90 | 0,65 |
| 2003 | 19,38 | 0,02 | 0,63 | 0,75 | 0,67 | 3,04 | 1,96 | 4,19 | 4,12 | -2,97 | 4,93 | -0,38 | 1,16 |
| 2004 | 9,06 | 5,01 | 2,17 | -1,44 | 0,79 | -1,29 | 2,18 | -2,29 | 0,58 | 0,44 | -0,44 | 1,68 | 1,52 |
| 2005 | 25,12 | 1,82 | 2,08 | -0,68 | -1,92 | 5,30 | 3,04 | 4,33 | 0,37 | 4,82 | -2,79 | 4,67 | 1,99 |
| 2006 | 12,03 | 5,71 | 2,97 | 1,83 | 0,97 | -4,26 | -1,41 | -0,16 | 0,55 | 1,53 | 1,47 | 0,73 | 1,80 |
| 2007 | 5,41 | 1,79 | -1,09 | 2,08 | 2,50 | 2,95 | -0,29 | -0,63 | -1,63 | 1,01 | 2,53 | -3,48 | -0,23 |
| 2008 | 8,69 | -0,54 | 0,59 | 1,36 | -0,10 | -0,02 | 0,23 | -0,40 | 0,65 | 2,54 | 2,55 | 1,25 | 0,31 |
| 2009 | 24,54 | -0,25 | 0,97 | -0,37 | 1,12 | 0,69 | 0,14 | 6,81 | 3,23 | 4,34 | -2,45 | 4,37 | 3,92 |
| 2010 | 19,22 | -0,41 | 2,50 | 5,81 | 1,01 | -1,67 | -0,83 | 0,15 | 0,29 | 3,47 | 3,05 | 2,15 | 2,43 |
| 2011 | 1,45 | -1,12 | 1,88 | -1,84 | 1,32 | 0,43 | -0,36 | -0,11 | 0,17 | 0,82 | -1,64 | 0,15 | 1,84 |
| 2012 | 11,58 | 1,26 | 2,11 | 2,16 | 0,80 | -1,44 | 0,20 | 3,08 | -0,06 | 0,58 | -0,46 | 2,00 | 0,87 |
| 2013 | 22,13 | 1,70 | 3,45 | 2,73 | 0,65 | 1,88 | -2,41 | 3,77 | -1,13 | 3,63 | 3,55 | 1,69 | 0,87 |
| 2014 | 9,09 | -0,40 | 3,28 | -1,20 | -0,64 | 3,73 | 0,80 | -1,69 | 2,32 | 0,13 | -0,72 | 3,25 | 0,07 |
| 2015 | 12,28 | 6,35 | 4,47 | 2,33 | -2,51 | 2,54 | -2,98 | 2,84 | -3,06 | 0,09 | 1,32 | 2,02 | -1,29 |
| 2016 | 4,79 | -2,40 | -1,30 | -0,13 | -0,64 | 0,64 | 0,44 | 2,98 | 0,61 | 1,11 | -1,18 | 1,48 | 3,24 |
| 2017 | 14,78 | 0,93 | 2,92 | 2,47 | 1,15 | 1,86 | -1,72 | 1,35 | 1,33 | 2,50 | 2,28 | -0,94 | -0,16 |
| 2018 | -2,20 | 1,30 | -2,38 | -1,99 | 0,15 | 1,25 | -0,56 | 1,06 | 1,59 | -0,46 | -1,13 | 0,08 | -1,04 |
| 2019 | 2,27 | 0,38 | 0,16 | 1,73 | | | | | | | | | |
| Mittelwert | 12,00 | 1,21 | 1,86 | 0,90 | 0,14 | 0,71 | 0,01 | 1,56 | 0,76 | 2,05 | 0,54 | 1,11 | 0,96 |