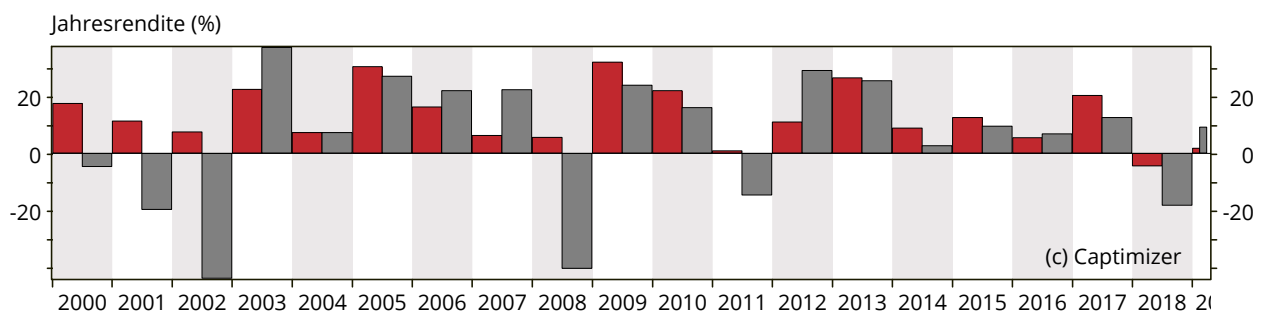
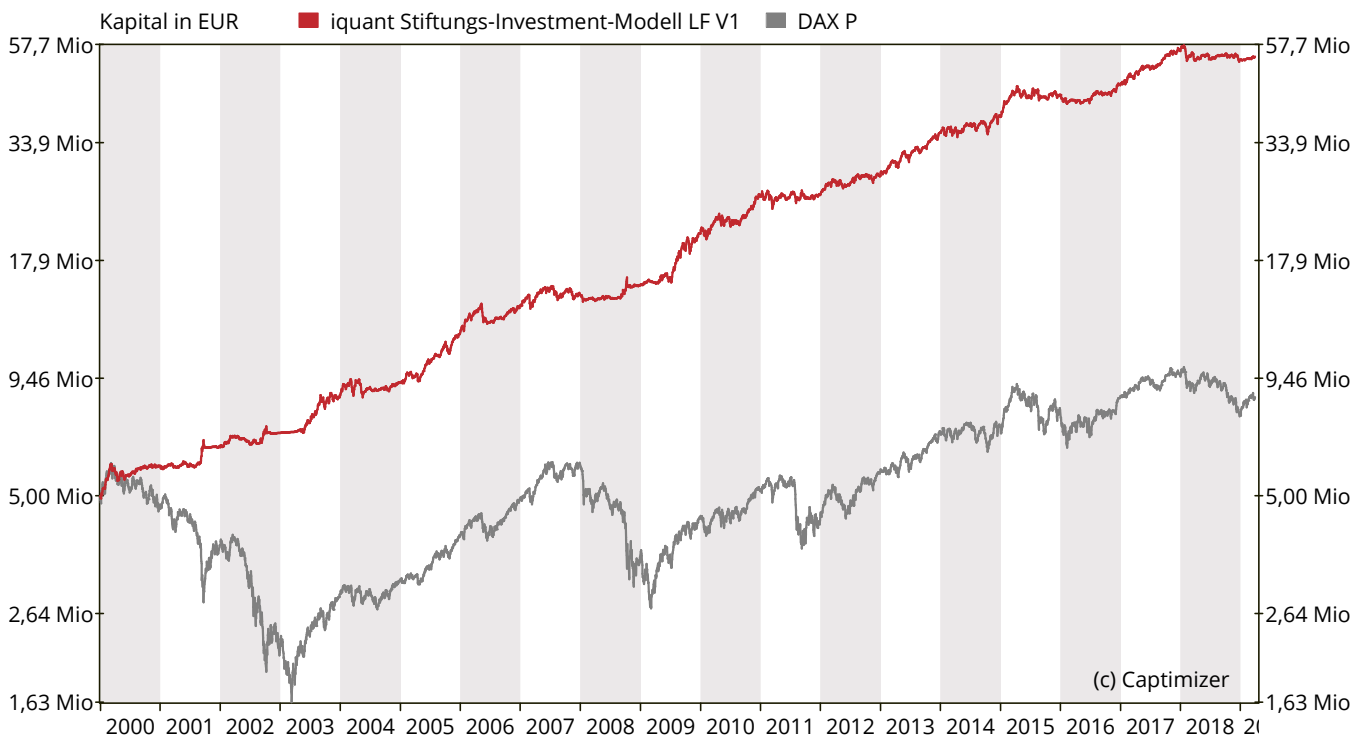


iquant Stiftungs-Investment-Modell LF V1

Basisdaten		Beschreibung	
Outperformance	910 % (10,34 % p.a.)	Das Modell wurde für ein Anlagevolumen von 5 Mio. Euro konzipiert und verteilt das Anlagekapital auf neun Subsysteme. LF steht für Low Frequency und trägt dem Umstand Rechnung, dass maximal 80 Transaktionen pro Kalenderjahr durchgeführt werden dürfen.	
Transaktionen	543 (28,2 p.a.)		
Benchmark	DAX P		
	Benchmark	Strategie	
Kapital		Subsysteme:	
Start 01/2000	5.000.000 EUR	5.000.000 EUR	1. Dividendestrategie mit 5 DAX-Aktien (15%)
Ende 03/2019	8.536.846 EUR	54.052.798 EUR	2. Dividendestrategie mit 5 Dow-Aktien (15%)
Rendite		3. Relative-Stärke-Strategie mit 5 HDaX-Aktien (15%)	
Rendite p.a. (geo.)	2,82 %	13,16 %	4. Saisonal Deutschland mit 1 ETF (10%)
Rendite 2018	-18,26 %	-4,54 %	5. MakroTrend Deutschland Small- und MidCaps mit SDAX- und MDAX-ETF (10%)
Rendite 2019 YTD	9,16 %	1,75 %	6. Globale Trendfolge Industrieländer mit MSCI World ETF (5%)
Risiko		7. Globale Trendfolge Schwellenländer mit MSCI EM ETF (5%)	
Maximaler Rückgang	-72,68 %	-10,42 %	8. Trendfolge Technologie mit NASDAQ100-ETF (10%)
Mittlerer Rückgang	-23,21 %	-2,84 %	9. Trendfolge mit Gold-ETF (10%)
Volatilität p.a.	20,50 %	8,61 %	
Längste Verlustperiode	7,31 J.	1,67 J.	
Rendite zu Risiko		Bei der Simulation der Anlageergebnisse wurden eine Managementgebühr von 0,96% 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.	
Rendite / Max. Rückgang	0,04	1,26	
Rendite / Mittel Rückgang	0,12	4,64	
Rendite / Volatilität p.a.	0,14	1,53	



iquant Stiftungs-Investment-Modell LF V1

Chance		3,5
Rendite p.a.	13,16 %	3,5
Outperformance p.a.	10,34 %	5,0
positive Monatsrenditen	67,10 %	4,5
Risiko		2,0
Maximaler Rückgang	-10,42 %	2,0
Mittlerer Rückgang	-2,84 %	1,0
Max. Verlustdauer	1,67 J.	1,5
Volatilität p.a.	8,61 %	1,5
Bequemlichkeit		3,5
Transaktionen p.a.	55,58	4,0
Handelstage p.a.	31,29	3,5
Anlagehorizont		3Jahre
Max. Verlustdauer	1,67 J.	

Max. Transaktionen im Kalenderjahr 77 (2018)

iquant Stiftungs-Investment-Modell LF V1

	Jahresrenditen (%)	Monatsrenditen (%)											
		Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez
2000	17,45	3,69	11,71	-0,66	-2,32	-2,39	1,66	1,75	2,58	0,68	0,25	0,56	-0,60
2001	11,35	-0,46	0,82	-0,43	0,06	1,73	-0,40	-1,58	1,98	8,84	-0,15	0,45	0,32
2002	7,50	2,21	1,51	2,01	-1,37	-0,78	-2,46	1,49	-0,91	7,62	-1,57	-0,34	0,23
2003	22,38	0,20	0,18	0,20	0,87	1,30	3,32	5,29	5,48	-3,51	7,58	-1,00	1,00
2004	7,32	5,33	1,81	-1,88	0,66	-3,44	2,50	-1,13	-0,15	0,09	0,41	1,25	1,93
2005	30,35	1,45	3,29	-1,28	-2,17	7,16	3,11	3,50	0,42	6,35	-3,74	6,63	2,75
2006	16,21	6,60	3,07	1,92	2,18	-5,65	-1,47	1,29	1,28	0,90	2,18	0,43	2,84
2007	6,29	3,17	-1,47	1,78	3,90	2,80	-1,21	-1,25	-1,75	1,48	2,18	-3,81	0,61
2008	5,57	-2,62	0,60	-0,92	0,73	0,94	-0,13	-0,50	0,26	3,85	1,94	1,42	0,01
2009	32,00	1,58	0,37	-0,80	1,28	2,32	-1,50	7,17	7,02	4,80	-3,41	5,04	4,85
2010	21,94	-1,28	1,79	6,02	1,31	-1,06	-0,80	-0,08	-0,36	3,77	4,34	3,39	3,30
2011	0,89	-1,35	2,46	-2,43	2,07	0,17	-0,34	0,61	-2,23	0,26	-0,14	1,60	0,34
2012	11,04	3,33	2,93	1,01	0,63	-2,50	0,94	3,23	-0,01	0,84	-1,00	0,84	0,44
2013	26,53	1,69	4,31	1,89	0,51	3,66	-1,60	3,74	-1,52	2,97	3,80	2,99	1,54
2014	8,83	-0,31	3,08	-0,98	-1,04	3,02	0,07	-1,01	1,89	0,74	-0,47	3,97	-0,29
2015	12,60	7,15	4,13	2,22	-1,63	1,42	-2,54	3,71	-2,45	-0,68	1,06	1,94	-1,90
2016	5,45	-1,93	-1,12	-0,08	-0,71	0,91	0,85	3,31	-0,23	0,38	-0,18	1,39	2,88
2017	20,29	0,55	4,29	1,55	1,49	1,76	-0,75	0,85	2,36	3,54	1,99	0,28	0,80
2018	-4,54	1,08	-3,13	-2,31	0,23	1,12	-1,05	0,15	1,69	0,65	-0,84	0,81	-2,89
2019	1,75	0,10	0,20	1,44									
Mittelwert	13,06	1,51	2,04	0,41	0,35	0,66	-0,09	1,61	0,81	2,29	0,75	1,47	0,96

Einstiegsdatum	Stückzahl	Einstiegsbetrag	Ausstiegsbetrag	Gewinn/Verlust	%-Gewinn/Verlust	Transaktionskosten	Strategie	Handelsrichtung	Analysiertes Wertpapier	Umsetzungsart	Positiongröße (%)
27.04.2018	33754	1.615.479,06	2.498.795,69	880.085,68	54,48	3.230,96	Div. 5 Dow-Aktien	LONG	Merck Co. DL-,01	Direkt	4,62
30.05.2018	53805	1.626.019,61	2.033.966,04	404.694,39	24,89	3.252,04	Div. 5 Dow-Aktien	LONG	Pfizer	Direkt	3,76
30.10.2018	49775	5.349.830,34	5.715.633,27	355.103,27	6,64	10.699,66	LT Gold-ETF	LONG	Gold Unze (USD)	ETF oder ETC	10,57
28.01.2019	631677	2.624.488,57	2.751.950,12	122.212,58	4,66	5.248,98	GlobalTrend EM	LONG	MSCI Emerging Markets Net	ETF oder ETC	5,09
13.02.2019	86134	5.357.687,85	5.655.081,84	286.678,61	5,35	10.715,38	LT NASDAQ100 ETF	LONG	Nasdaq 100	ETF oder ETC	10,46
18.02.2019	10996	2.690.004,26	2.716.820,20	24.125,94	0,90	2.690,00	MakroTrend MidCaps	LONG	MDAX	ETF oder ETC	5,03
19.02.2019	50735	2.684.015,95	2.748.466,09	59.082,11	2,20	5.368,03	GlobalTrend World	LONG	MSCI World Net	ETF oder ETC	5,08
21.02.2019	69788	1.608.264,46	1.361.563,88	-249.917,11	-15,54	3.216,53	Div. 5 DAX-Aktien	LONG	Deutsche Lufthansa AG	Direkt	2,52
21.02.2019	115269	1.602.383,19	1.707.133,89	101.545,94	6,34	3.204,77	Div. 5 DAX-Aktien	LONG	Deutsche Telekom AG	Direkt	3,16
21.02.2019	165878	1.604.330,55	1.647.666,17	40.126,97	2,50	3.208,66	Div. 5 DAX-Aktien	LONG	E.ON SE	Direkt	3,05
21.02.2019	10740	1.617.444,00	1.667.385,00	46.706,11	2,89	3.234,89	Div. 5 DAX-Aktien	LONG	Linde PLC	Direkt	3,08
21.02.2019	7762	1.604.017,30	1.637.782,00	30.556,67	1,91	3.208,03	Div. 5 DAX-Aktien	LONG	Münchener Rück	Direkt	3,03
27.02.2019	15228	1.610.153,00	1.669.636,26	56.262,95	3,49	3.220,31	Div. 5 Dow-Aktien	LONG	Chevron Corp.	Direkt	3,09
27.02.2019	35686	1.608.993,61	1.714.944,22	102.732,62	6,38	3.217,99	Div. 5 Dow-Aktien	LONG	Cisco Systems	Direkt	3,17
14.03.2019	24899	2.703.140,08	2.721.183,34	15.340,12	0,57	2.703,14	MakroTrend MidCaps	LONG	SDAX	ETF oder ETC	5,03
28.03.2019	13054	1.627.254,26	1.639.492,46	8.983,69	0,55	3.254,51	Div. 5 Dow-Aktien	LONG	IBM	Direkt	3,03