

# iquant Stiftungs-Investment-Modell 50 V1

Basisdaten	
Outperformance	823 % (8,88 % p.a.)
Transaktionen	2888 (144,4 p.a.)
Benchmark	DAX
	Benchmark <span style="color: red;">Strategie</span>
Kapital	
Start 01/2000	50.000.000 EUR <span style="color: red;">50.000.000 EUR</span>
Ende 12/2019	98.129.766 EUR <span style="color: red;">509.500.453 EUR</span>
Rendite	
Rendite p.a. (geo.)	3,43 % <span style="color: red;">12,30 %</span>
Rendite 2018	-18,26 % <span style="color: red;">-2,06 %</span>
Rendite 2019 YTD	25,48 % <span style="color: red;">7,63 %</span>
Risiko	
Maximaler Rückgang	-72,68 % <span style="color: red;">-8,46 %</span>
Mittlerer Rückgang	-22,67 % <span style="color: red;">-2,26 %</span>
Volatilität p.a.	20,28 % <span style="color: red;">7,13 %</span>
Längste Verlustperiode	7,31 J. <span style="color: red;">1,67 J.</span>
Rendite zu Risiko	
Rendite / Max. Rückgang	0,05 <span style="color: red;">1,45</span>
Rendite / Mittel Rückgang	0,15 <span style="color: red;">5,44</span>
Rendite / Volatilität p.a.	0,17 <span style="color: red;">1,73</span>

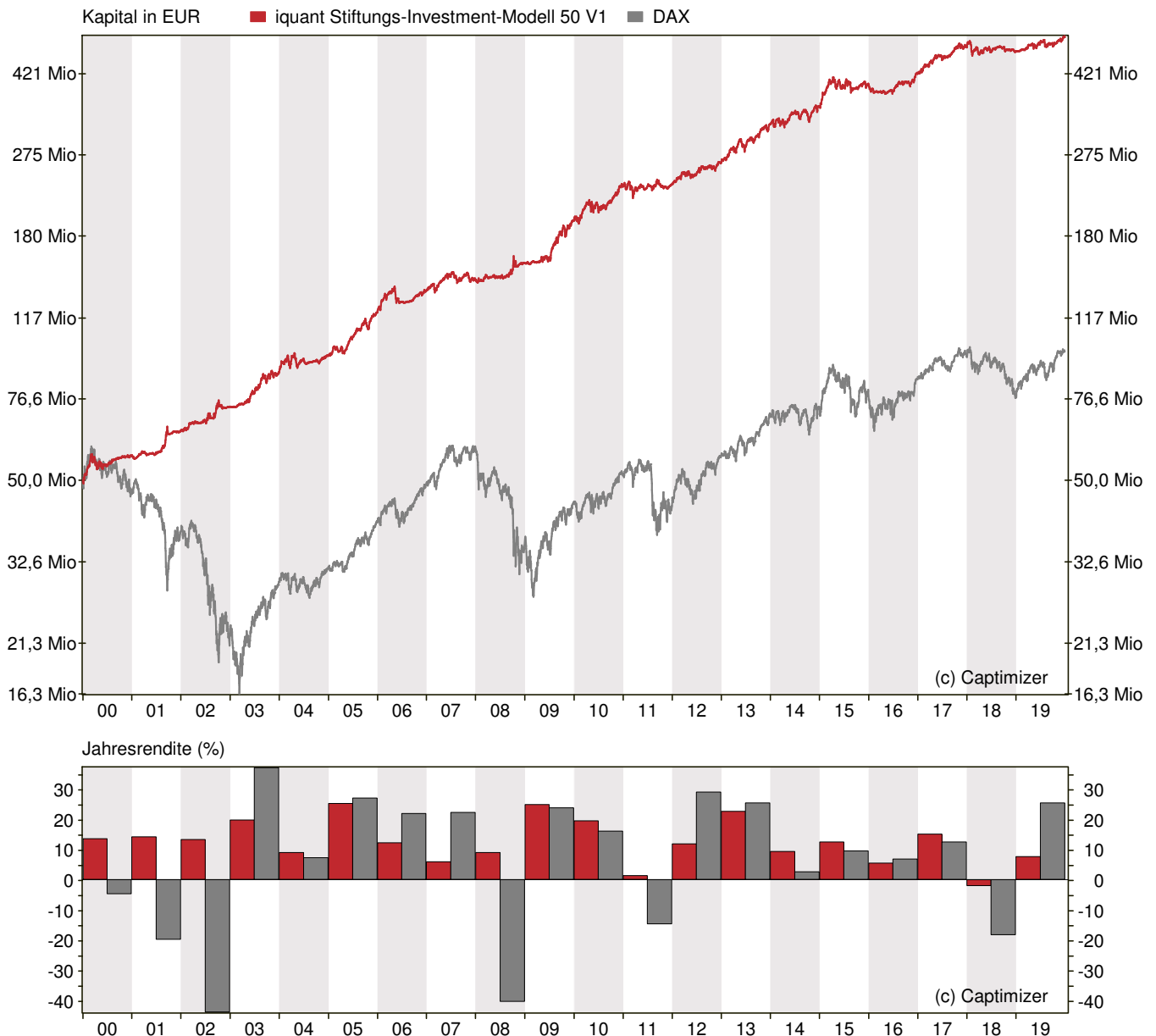
## Beschreibung

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.

### 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 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

	Jahres- renditen (%)	Monatsrenditen (%)											
		Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez
2000	13,56	2,91	8,88	-0,59	-1,63	-2,22	0,82	1,52	1,95	0,89	0,02	1,14	-0,47
2001	14,22	-1,19	2,06	0,99	-1,10	0,59	0,44	0,42	3,33	6,28	0,87	0,15	0,75
2002	13,34	1,39	0,92	2,12	0,12	-0,47	0,62	2,46	-0,82	8,28	-1,48	-0,88	0,69
2003	19,79	0,05	0,67	0,79	0,69	3,06	1,98	4,23	4,15	-2,95	4,98	-0,35	1,18
2004	9,04	5,03	2,20	-1,40	0,84	-1,37	2,13	-2,34	0,53	0,47	-0,43	1,69	1,55
2005	25,28	1,85	2,05	-0,65	-1,90	5,31	3,06	4,33	0,39	4,79	-2,80	4,70	2,02
2006	12,29	5,72	2,99	1,84	1,01	-4,24	-1,39	-0,13	0,58	1,58	1,43	0,79	1,76
2007	5,93	1,81	-1,09	2,13	2,54	3,03	-0,20	-0,53	-1,54	0,92	2,67	-3,58	-0,15
2008	9,01	-0,52	0,63	1,41	-0,08	0,00	0,24	-0,36	0,67	2,57	2,54	1,27	0,34
2009	24,86	-0,22	1,01	-0,34	1,13	0,73	0,19	6,85	3,25	4,35	-2,47	4,47	3,85
2010	19,48	-0,43	2,49	5,85	0,99	-1,59	-0,81	0,16	0,31	3,49	3,07	2,18	2,47
2011	1,40	-1,09	1,71	-1,85	1,35	0,38	-0,31	-0,08	0,16	0,82	-1,64	0,17	1,86
2012	11,86	1,27	2,13	2,19	0,83	-1,45	0,23	3,09	-0,03	0,61	-0,43	2,04	0,87
2013	22,63	1,77	3,52	2,79	0,68	1,84	-2,35	3,86	-1,13	3,63	3,58	1,78	0,82
2014	9,39	-0,35	3,23	-1,16	-0,62	3,78	0,82	-1,59	2,24	0,11	-0,67	3,31	0,11
2015	12,47	6,42	4,44	2,36	-2,46	2,57	-3,03	2,88	-2,88	0,05	1,27	2,00	-1,29
2016	5,49	-2,34	-1,27	-0,11	-0,67	0,72	0,50	3,04	0,71	1,15	-0,97	1,41	3,34
2017	15,08	0,91	2,97	2,46	1,21	1,90	-1,69	1,37	1,35	2,52	2,29	-0,91	-0,13
2018	-2,06	1,32	-2,41	-1,99	0,18	1,26	-0,53	1,08	1,61	-0,43	-1,13	0,10	-1,04
2019	7,63	0,39	0,16	1,78	1,62	-2,31	2,34	1,02	-0,84	0,38	-0,03	2,02	0,94
Mittelwert	12,53	1,23	1,86	0,93	0,24	0,58	0,15	1,57	0,70	1,98	0,53	1,17	0,97