

# iquant Stiftungs-Investment-Modell LF V1

Basisdaten		
Outperformance	1.136 % (10,39 % p.a.)	
Transaktionen	565 (28,2 p.a.)	
Benchmark	DAX	
	Benchmark	Strategie
Kapital		
Start 01/2000	5.000.000 EUR	5.000.000 EUR
Ende 12/2019	9.812.977 EUR	66.627.739 EUR
Rendite		
Rendite p.a. (geo.)	3,43 %	13,82 %
Rendite 2018	-18,26 %	-3,73 %
Rendite 2019 YTD	25,48 %	9,80 %
Risiko		
Maximaler Rückgang	-72,68 %	-10,28 %
Mittlerer Rückgang	-22,67 %	-2,65 %
Volatilität p.a.	20,28 %	8,53 %
Längste Verlustperiode	7,31 J.	1,81 J.
Rendite zu Risiko		
Rendite / Max. Rückgang	0,05	1,34
Rendite / Mittel Rückgang	0,15	5,22
Rendite / Volatilität p.a.	0,17	1,62

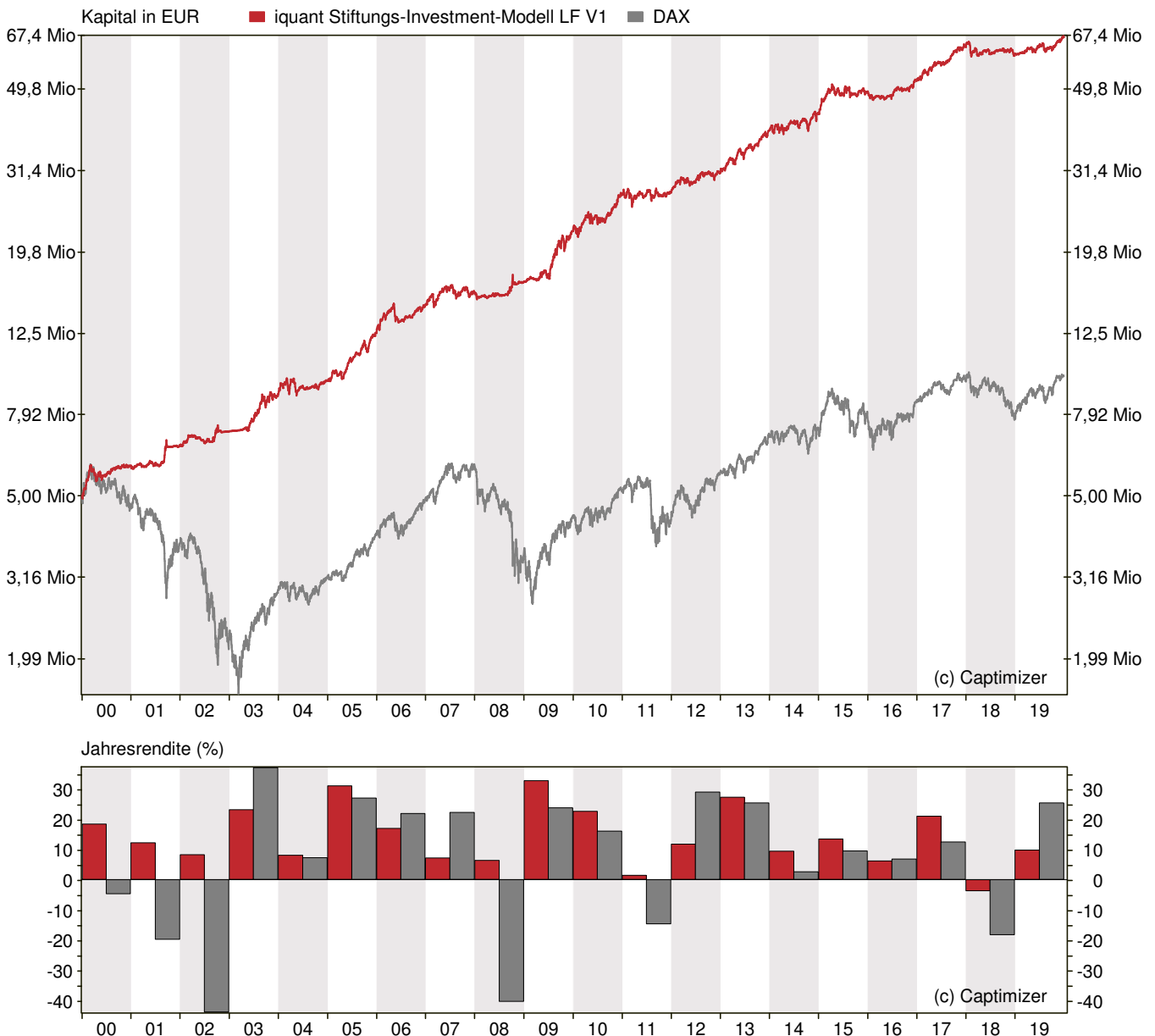
## Beschreibung

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.

### Subsysteme:

1. Dividendestrategie mit 5 DAX-Aktien (15%)
2. Dividendestrategie mit 5 Dow-Aktien (15%)
3. Relative-Stärke-Strategie mit 5 HDaX-Aktien (15%)
4. Saisonal Deutschland mit 1 ETF (10%)
5. MakroTrend Deutschland Small- und MidCaps mit SDAX- und MDAX-ETF (10%)
6. Globale Trendfolge Industrieländer mit MSCI World ETF (5%)
7. Globale Trendfolge Schwellenländer mit MSCI EM ETF (5%)
8. Trendfolge Technologie mit NASDAQ100-ETF (10%)
9. Trendfolge mit Gold-ETF (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 LF V1

	Jahresrenditen (%)	Monatsrenditen (%)											
		Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez
2000	18,46	3,80	11,75	-0,61	-2,22	-2,32	1,75	1,81	2,63	0,75	0,32	0,64	-0,51
2001	12,20	-0,40	0,85	-0,36	0,14	1,77	-0,33	-1,50	2,04	8,94	-0,10	0,51	0,37
2002	8,32	2,28	1,55	2,05	-1,32	-0,72	-2,39	1,57	-0,81	7,69	-1,49	-0,29	0,28
2003	23,17	0,24	0,22	0,24	0,94	1,35	3,37	5,36	5,52	-3,44	7,63	-0,94	1,06
2004	8,13	5,43	1,84	-1,83	0,72	-3,41	2,55	-1,02	-0,08	0,14	0,47	1,31	1,99
2005	31,14	1,54	3,32	-1,18	-2,13	7,21	3,16	3,55	0,44	6,40	-3,69	6,65	2,80
2006	17,00	6,66	3,10	1,97	2,21	-5,53	-1,39	1,36	1,32	0,96	2,23	0,48	2,89
2007	7,17	3,24	-1,42	1,82	3,95	2,83	-1,15	-1,15	-1,67	1,55	2,26	-3,70	0,69
2008	6,40	-2,52	0,66	-0,87	0,79	1,01	-0,06	-0,45	0,32	3,93	2,03	1,45	0,06
2009	32,77	1,62	0,40	-0,75	1,34	2,36	-1,44	7,24	7,08	4,84	-3,36	5,07	4,89
2010	22,70	-1,21	1,84	6,07	1,36	-1,00	-0,76	0,01	-0,31	3,82	4,38	3,43	3,34
2011	1,45	-1,30	2,49	-2,44	2,20	0,24	-0,37	0,62	-2,21	0,37	-0,08	1,65	0,39
2012	11,75	3,39	2,95	1,05	0,68	-2,42	0,98	3,28	0,03	0,88	-0,93	0,91	0,53
2013	27,36	1,83	4,37	1,97	0,54	3,66	-1,52	3,82	-1,49	3,01	3,87	3,05	1,54
2014	9,47	-0,19	3,14	-0,93	-1,01	2,99	0,11	-0,94	1,94	0,79	-0,42	4,01	-0,25
2015	13,50	7,30	4,19	2,27	-1,59	1,44	-2,48	3,76	-2,34	-0,60	1,10	1,99	-1,83
2016	6,20	-1,84	-1,06	-0,01	-0,64	0,97	0,89	3,36	-0,18	0,43	-0,13	1,45	2,93
2017	21,08	0,61	4,32	1,60	1,54	1,83	-0,70	0,94	2,42	3,59	2,04	0,34	0,85
2018	-3,73	1,18	-3,05	-2,24	0,29	1,19	-0,98	0,20	1,75	0,71	-0,76	0,87	-2,80
2019	9,80	0,15	0,29	1,49	1,64	-2,65	3,14	1,09	-1,58	0,62	0,85	3,22	1,29
Mittelwert	14,22	1,59	2,09	0,47	0,47	0,54	0,12	1,65	0,74	2,27	0,81	1,60	1,03