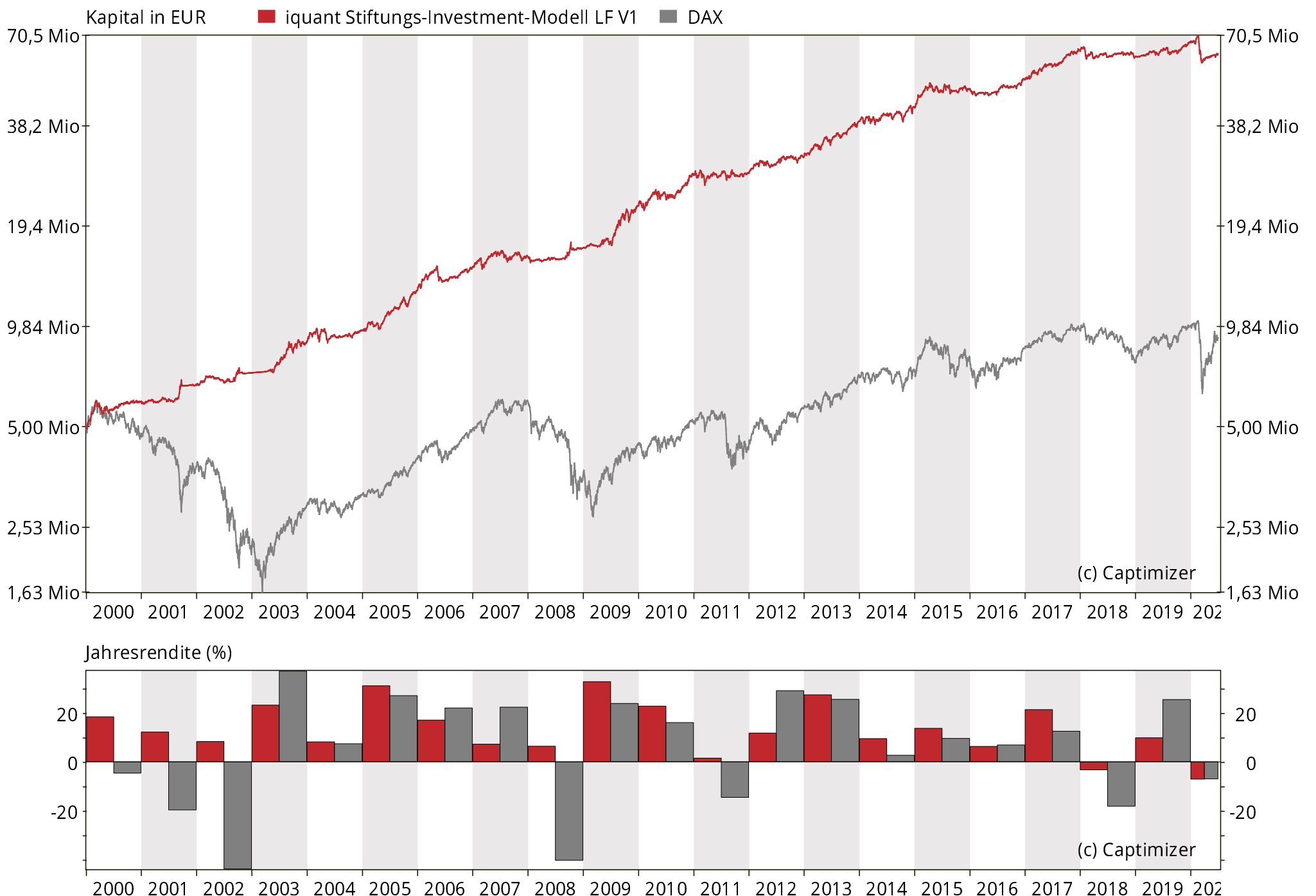


iquant Stiftungs-Investment-Modell LF V1

Basisdaten		Beschreibung	
Outperformance	1.062 % (10,11 % 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	584 (28,5 p.a.)	Subsysteme:	
Benchmark	DAX	<ol style="list-style-type: none"> 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%) 	
	Benchmark	Strategie	
Kapital		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.	
Start 01/2000	5.000.000 EUR	5.000.000 EUR	
Ende 06/2020	9.118.181 EUR	62.211.634 EUR	
Rendite			
Rendite p.a. (geo.)	2,97 %	13,08 %	
Rendite 2019	25,48 %	9,82 %	
Rendite 2020 YTD	-7,08 %	-7,20 %	
Risiko			
Maximaler Rückgang	-72,68 %	-16,60 %	
Mittlerer Rückgang	-22,47 %	-2,78 %	
Volatilität p.a.	20,66 %	8,67 %	
Längste Verlustperiode	7,31 J.	1,81 J.	
Rendite zu Risiko			
Rendite / Max. Rückgang	0,04	0,79	
Rendite / Mittel Rückgang	0,13	4,70	
Rendite / Volatilität p.a.	0,14	1,51	



iquant Stiftungs-Investment-Modell LF V1

	Jahresrenditen (%)	Monatsrenditen (%)											
		Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez
2000	18,42	3,80	11,75	-0,61	-2,22	-2,33	1,73	1,82	2,61	0,76	0,30	0,65	-0,52
2001	12,19	-0,40	0,84	-0,35	0,12	1,78	-0,32	-1,52	2,05	8,94	-0,10	0,51	0,38
2002	8,27	2,24	1,55	2,04	-1,32	-0,71	-2,40	1,57	-0,81	7,69	-1,49	-0,29	0,28
2003	23,16	0,24	0,22	0,24	0,94	1,35	3,37	5,36	5,52	-3,45	7,63	-0,94	1,06
2004	8,12	5,42	1,83	-1,83	0,72	-3,41	2,55	-1,02	-0,08	0,14	0,48	1,31	1,98
2005	31,11	1,54	3,33	-1,23	-2,12	7,21	3,15	3,55	0,46	6,39	-3,68	6,65	2,80
2006	16,99	6,67	3,10	1,96	2,21	-5,53	-1,39	1,36	1,32	0,96	2,23	0,49	2,89
2007	7,17	3,24	-1,42	1,83	3,94	2,83	-1,14	-1,15	-1,68	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	32,75	1,62	0,40	-0,75	1,34	2,36	-1,44	7,24	7,07	4,83	-3,35	5,08	4,88
2010	22,76	-1,16	1,84	6,07	1,35	-1,00	-0,75	0,01	-0,31	3,82	4,38	3,43	3,34
2011	1,45	-1,30	2,49	-2,44	2,19	0,24	-0,36	0,62	-2,22	0,37	-0,08	1,65	0,39
2012	11,76	3,38	2,95	1,05	0,68	-2,42	0,98	3,29	0,03	0,88	-0,94	0,91	0,53
2013	27,37	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	9,46	-0,20	3,14	-0,93	-1,01	2,99	0,11	-0,94	1,94	0,79	-0,41	4,01	-0,25
2015	13,63	7,30	4,20	2,27	-1,60	1,45	-2,48	3,76	-2,32	-0,52	1,13	1,99	-1,83
2016	6,28	-1,84	-1,06	-0,01	-0,64	1,02	0,93	3,36	-0,18	0,43	-0,13	1,45	2,92
2017	21,28	0,61	4,31	1,60	1,54	1,84	-0,70	0,95	2,50	3,64	2,08	0,34	0,85
2018	-3,41	1,17	-3,01	-2,22	0,29	1,18	-0,98	0,23	1,82	0,78	-0,69	0,88	-2,78
2019	9,82	0,15	0,29	1,49	1,64	-2,65	3,14	1,09	-1,56	0,63	0,85	3,22	1,29
2020	-7,20	-0,82	-6,58	-3,88	1,73	1,21	1,21						
Mittelwert	13,23	1,48	1,68	0,26	0,53	0,57	0,17	1,65	0,75	2,28	0,82	1,61	1,02