

iquant Stiftungs-Investment-Modell 50 V1

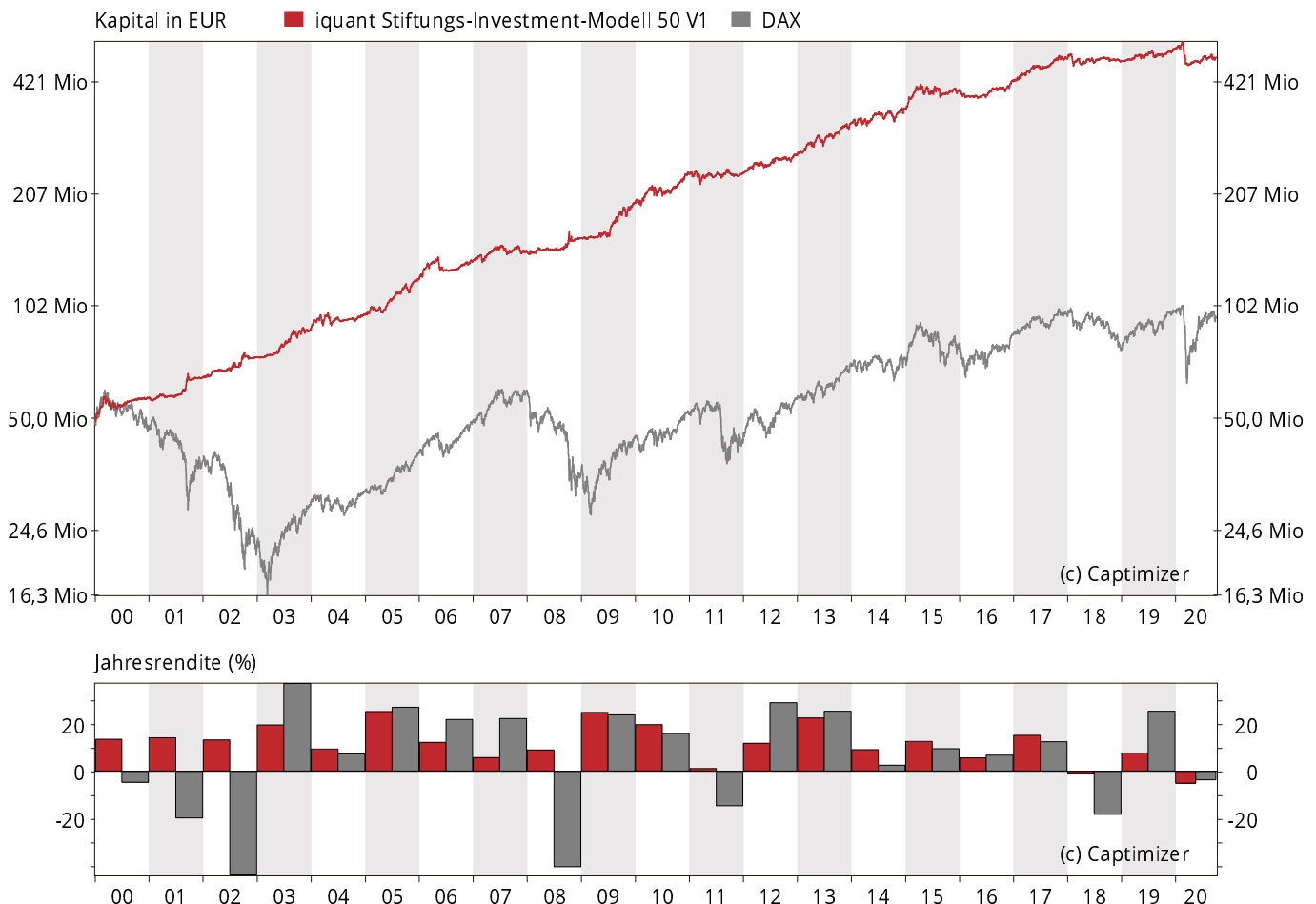
| Basisdaten | | Beschreibung | |
|----------------------------|---------------------|--|--|
| Outperformance | 795 % (8,53 % p.a.) | Das Modell wurde für ein Anlagevolumen von 50 Mio. Euro konzipiert und verteilt das Anlagekapital auf acht Subsysteme, die sich aus mehreren Strategien zusammensetzen. 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 | 3063 (147,6 p.a.) | | |
| Benchmark | DAX | | |
| | Benchmark | Strategie | |
| Kapital | | | |
| Start 01/2000 | 50.000.000 EUR | 50.000.000 EUR | |
| Ende 09/2020 | 94.513.284 EUR | 491.976.458 EUR | |
| Rendite | | | |
| Rendite p.a. (geo.) | 3,11 % | 11,64 % | |
| Rendite 2019 | 25,48 % | 7,79 % | |
| Rendite 2020 YTD | -3,69 % | -5,05 % | |
| Risiko | | | |
| Maximaler Rückgang | -72,68 % | -13,86 % | |
| Mittlerer Rückgang | -22,28 % | -2,45 % | |
| Volatilität p.a. | 20,56 % | 7,23 % | |
| Längste Verlustperiode | 7,31 J. | 1,67 J. | |
| Rendite zu Risiko | | | |
| Rendite / Max. Rückgang | 0,04 | 0,84 | |
| Rendite / Mittel Rückgang | 0,14 | 4,76 | |
| Rendite / Volatilität p.a. | 0,15 | 1,61 | |

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



iquant Stiftungs-Investment-Modell 50 V1

| | Jahresrenditen (%) | Monatsrenditen (%) | | | | | | | | | | | |
|------------|--------------------|--------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| | | Jan | Feb | Mär | Apr | Mai | Jun | Jul | Aug | Sep | Okt | Nov | Dez |
| 2000 | 13,63 | 3,00 | 8,87 | -0,58 | -1,63 | -2,22 | 0,82 | 1,52 | 1,95 | 0,89 | 0,01 | 1,14 | -0,47 |
| 2001 | 14,26 | -1,19 | 2,06 | 0,98 | -1,05 | 0,59 | 0,44 | 0,42 | 3,33 | 6,28 | 0,88 | 0,15 | 0,75 |
| 2002 | 13,31 | 1,37 | 0,91 | 2,12 | 0,12 | -0,47 | 0,62 | 2,46 | -0,82 | 8,28 | -1,48 | -0,88 | 0,69 |
| 2003 | 19,67 | 0,05 | 0,67 | 0,81 | 0,69 | 3,08 | 1,93 | 4,18 | 4,15 | -2,94 | 4,99 | -0,39 | 1,18 |
| 2004 | 9,47 | 5,04 | 2,20 | -1,40 | 0,83 | -1,29 | 2,35 | -2,29 | 0,59 | 0,47 | -0,43 | 1,69 | 1,55 |
| 2005 | 25,23 | 1,84 | 2,05 | -0,68 | -1,90 | 5,31 | 3,06 | 4,33 | 0,40 | 4,78 | -2,80 | 4,70 | 2,01 |
| 2006 | 12,29 | 5,72 | 2,99 | 1,84 | 1,01 | -4,24 | -1,38 | -0,13 | 0,58 | 1,58 | 1,43 | 0,79 | 1,75 |
| 2007 | 5,85 | 1,81 | -1,08 | 2,09 | 2,60 | 3,06 | -0,26 | -0,60 | -1,55 | 0,93 | 2,68 | -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 | 24,92 | -0,22 | 1,01 | -0,35 | 1,13 | 0,73 | 0,19 | 6,85 | 3,27 | 4,31 | -2,47 | 4,47 | 3,91 |
| 2010 | 19,70 | -0,39 | 2,49 | 5,91 | 1,06 | -1,54 | -0,84 | 0,12 | 0,27 | 3,53 | 3,04 | 2,26 | 2,46 |
| 2011 | 1,18 | -1,09 | 1,70 | -1,93 | 1,21 | 0,42 | -0,34 | -0,12 | 0,21 | 0,82 | -1,64 | 0,15 | 1,86 |
| 2012 | 11,86 | 1,27 | 2,13 | 2,22 | 0,83 | -1,45 | 0,26 | 3,08 | -0,02 | 0,60 | -0,47 | 2,03 | 0,86 |
| 2013 | 22,64 | 1,77 | 3,52 | 2,79 | 0,68 | 1,83 | -2,35 | 3,86 | -1,13 | 3,64 | 3,58 | 1,78 | 0,82 |
| 2014 | 9,14 | -0,35 | 3,23 | -1,16 | -0,62 | 3,78 | 0,82 | -1,65 | 2,18 | 0,11 | -0,71 | 3,26 | 0,09 |
| 2015 | 12,62 | 6,43 | 4,44 | 2,36 | -2,48 | 2,57 | -3,03 | 2,88 | -2,86 | 0,10 | 1,30 | 2,00 | -1,28 |
| 2016 | 5,76 | -2,32 | -1,23 | -0,09 | -0,67 | 0,79 | 0,55 | 3,04 | 0,71 | 1,15 | -0,91 | 1,42 | 3,34 |
| 2017 | 15,27 | 0,91 | 2,97 | 2,46 | 1,21 | 1,90 | -1,69 | 1,34 | 1,43 | 2,51 | 2,38 | -0,84 | -0,17 |
| 2018 | -1,16 | 1,36 | -2,21 | -1,96 | 0,20 | 1,26 | -0,53 | 1,14 | 1,76 | -0,28 | -0,93 | 0,15 | -1,02 |
| 2019 | 7,79 | 0,40 | 0,16 | 1,78 | 1,60 | -2,31 | 2,33 | 1,02 | -0,82 | 0,48 | 0,01 | 2,02 | 0,94 |
| 2020 | -5,05 | -0,47 | -5,30 | -3,56 | 1,16 | 0,61 | 1,16 | -0,29 | 2,48 | -0,71 | | | |
| Mittelwert | 11,78 | 1,16 | 1,53 | 0,72 | 0,28 | 0,59 | 0,21 | 1,47 | 0,80 | 1,86 | 0,55 | 1,18 | 0,97 |