

iquant Stiftungs-Investment-Modell LF V1

Basisdaten		
Outperformance	1.109 % (9,60 % p.a.)	
Transaktionen	606 (28,8 p.a.)	
Benchmark	DAX	
	Benchmark	Strategie
Kapital		
Start 01/2000	5.000.000 EUR	5.000.000 EUR
Ende 12/2020	10.160.915 EUR	65.597.670 EUR
Rendite		
Rendite p.a. (geo.)	3,43 %	13,03 %
Rendite 2019	25,48 %	10,48 %
Rendite 2020 YTD	3,55 %	-1,28 %
Risiko		
Maximaler Rückgang	-72,68 %	-16,58 %
Mittlerer Rückgang	-22,08 %	-3,00 %
Volatilität p.a.	20,81 %	8,67 %
Längste Verlustperiode	7,31 J.	1,80 J.
Rendite zu Risiko		
Rendite / Max. Rückgang	0,05	0,79
Rendite / Mittel Rückgang	0,16	4,35
Rendite / Volatilität p.a.	0,16	1,50

Beschreibung

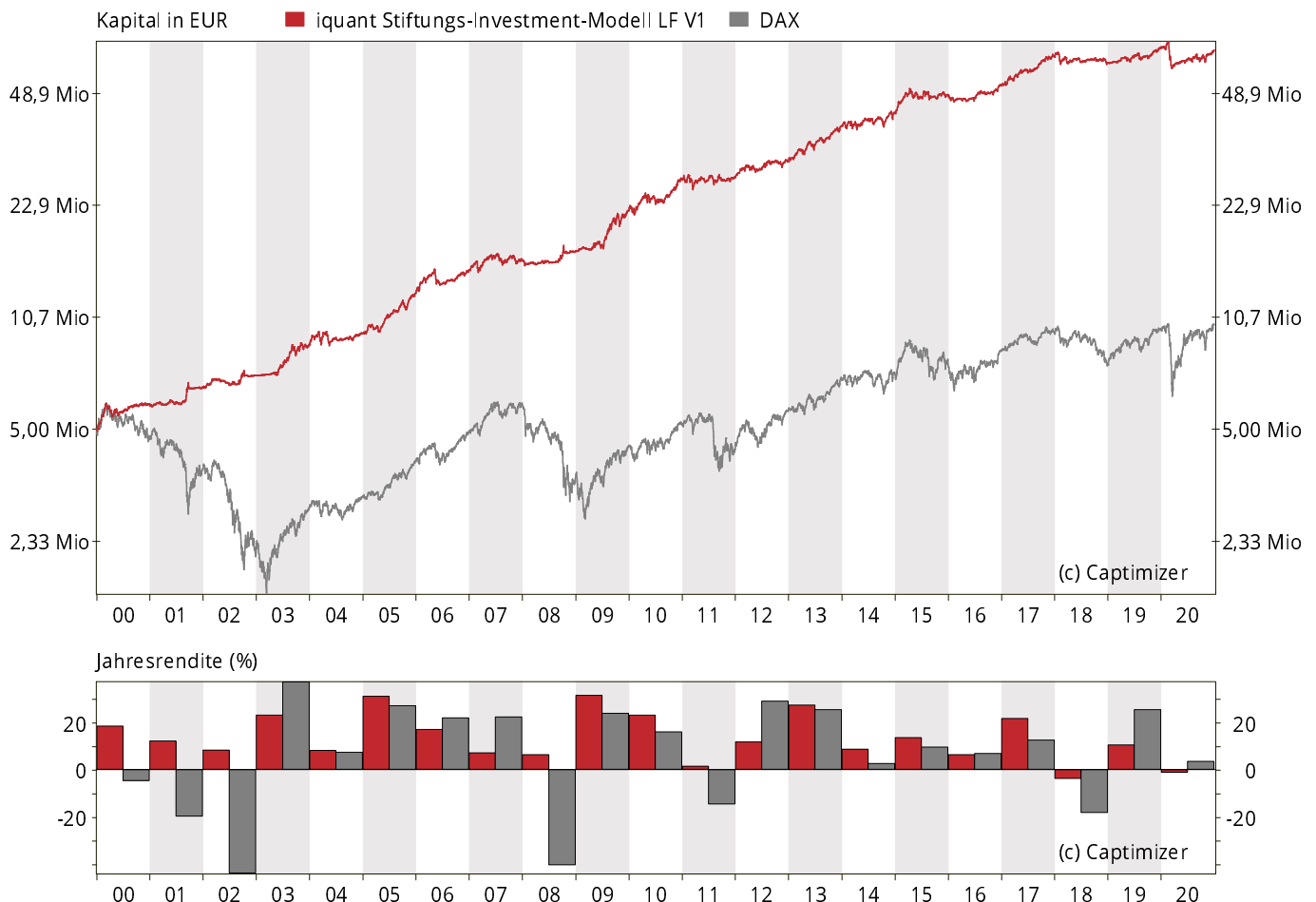
Das Modell wurde für ein Anlagevolumen von 5 Mio. Euro konzipiert und verteilt das Anlagekapital auf neun Subsysteme. LF steht für Low Frequency und trägt dem Umstand Rechnung, dass maximal 80 Transaktionen pro Kalenderjahr durchgeführt werden dürfen.

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	18,42	3,80	11,75	-0,61	-2,22	-2,33	1,74	1,81	2,62	0,75	0,32	0,64	-0,51
2001	12,20	-0,40	0,84	-0,34	0,13	1,79	-0,33	-1,51	2,04	8,94	-0,10	0,51	0,38
2002	8,27	2,24	1,55	2,05	-1,32	-0,71	-2,39	1,57	-0,81	7,69	-1,49	-0,29	0,28
2003	23,15	0,24	0,22	0,24	0,94	1,35	3,37	5,36	5,52	-3,44	7,62	-0,94	1,06
2004	8,19	5,43	1,84	-1,82	0,71	-3,36	2,55	-1,02	-0,08	0,14	0,47	1,31	1,99
2005	31,10	1,54	3,32	-1,23	-2,12	7,21	3,15	3,56	0,45	6,39	-3,68	6,66	2,80
2006	16,99	6,67	3,10	1,97	2,21	-5,54	-1,39	1,36	1,32	0,96	2,23	0,48	2,89
2007	7,17	3,24	-1,42	1,83	3,94	2,83	-1,15	-1,15	-1,67	1,54	2,27	-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	31,50	1,62	0,40	-0,75	1,34	2,36	-1,45	6,95	6,85	4,71	-3,19	4,55	4,88
2010	23,11	-1,18	2,29	6,11	1,87	-0,99	-1,37	-0,11	-0,31	3,83	4,39	3,44	3,35
2011	1,48	-1,30	2,50	-2,43	2,19	0,24	-0,35	0,63	-2,20	0,36	-0,07	1,65	0,38
2012	11,77	3,40	2,95	1,06	0,67	-2,42	0,99	3,29	0,03	0,88	-0,94	0,91	0,52
2013	27,36	1,82	4,37	1,97	0,54	3,67	-1,53	3,82	-1,49	3,01	3,86	3,05	1,55
2014	8,73	-0,20	2,90	-0,89	-0,99	3,03	0,06	-1,02	1,72	0,66	-0,31	3,90	-0,30
2015	13,53	6,92	4,35	2,16	-1,45	1,30	-2,45	3,65	-1,99	-0,55	1,10	1,99	-1,83
2016	6,31	-1,85	-1,06	-0,01	-0,64	0,98	0,89	3,36	-0,18	0,42	-0,13	1,50	2,98
2017	21,64	0,47	4,48	1,62	1,72	1,78	-0,60	0,82	2,55	3,62	2,34	0,43	0,65
2018	-3,88	1,46	-2,64	-2,23	0,36	1,00	-1,07	-0,05	1,53	0,70	-0,83	0,76	-2,81
2019	10,48	0,43	-0,16	1,65	1,84	-2,85	3,02	1,87	-1,47	0,85	0,76	3,08	1,14
2020	-1,28	-0,99	-6,57	-3,88	1,72	1,21	1,21	-1,52	3,90	-1,78	-2,16	5,09	3,11
Mittelwert	13,46	1,47	1,70	0,27	0,58	0,55	0,13	1,49	0,89	2,08	0,69	1,74	1,11