

# iquant Stiftungs-Investment-Modell 50 V1

Basisdaten		
Outperformance	861 % (7,80 % p.a.)	
Transaktionen	3192 (148,4 p.a.)	
Benchmark	DAX P	
	Benchmark	Strategie
Kapital		
Start 01/2000	50.000.000 EUR	50.000.000 EUR
Ende 06/2021	115.031.789 EUR	545.396.399 EUR
Rendite		
Rendite p.a. (geo.)	3,95 %	11,75 %
Rendite 2020	3,55 %	-0,24 %
Rendite 2021 YTD	13,21 %	7,88 %
Risiko		
Maximaler Rückgang	-72,68 %	-14,03 %
Mittlerer Rückgang	-21,59 %	-2,53 %
Volatilität p.a.	20,66 %	7,23 %
Längste Verlustperiode	7,31 J.	1,67 J.
Rendite zu Risiko		
Rendite / Max. Rückgang	0,05	0,84
Rendite / Mittel Rückgang	0,18	4,64
Rendite / Volatilität p.a.	0,19	1,63

## 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.

