

iquant Stiftungs-Investment-Modell LF V1

Basisdaten		
Outperformance	1.192 % (9,19 % p.a.)	
Transaktionen	618 (28,7 p.a.)	
Benchmark	DAX P	
	Benchmark	Strategie
Kapital		
Start 01/2000	5.000.000 EUR	5.000.000 EUR
Ende 06/2021	11.503.179 EUR	71.101.314 EUR
Rendite		
Rendite p.a. (geo.)	3,95 %	13,14 %
Rendite 2020	3,55 %	-1,28 %
Rendite 2021 YTD	13,21 %	8,58 %
Risiko		
Maximaler Rückgang	-72,68 %	-16,59 %
Mittlerer Rückgang	-21,59 %	-2,96 %
Volatilität p.a.	20,66 %	8,59 %
Längste Verlustperiode	7,31 J.	1,80 J.
Rendite zu Risiko		
Rendite / Max. Rückgang	0,05	0,79
Rendite / Mittel Rückgang	0,18	4,43
Rendite / Volatilität p.a.	0,19	1,53

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.

