

iquant Stiftungs-Investment-Modell LF V1

Basisdaten		
Outperformance	1.182 % (9,11 % p.a.)	
Transaktionen	626 (28,8 p.a.)	
Benchmark	DAX P	
	Benchmark	Strategie
Kapital		
Start 01/2000	5.000.000 EUR	5.000.000 EUR
Ende 09/2021	11.302.942 EUR	70.423.515 EUR
Rendite		
Rendite p.a. (geo.)	3,82 %	12,93 %
Rendite 2020	3,55 %	-1,31 %
Rendite 2021 YTD	11,24 %	7,59 %
Risiko		
Maximaler Rückgang	-72,68 %	-16,58 %
Mittlerer Rückgang	-21,35 %	-2,94 %
Volatilität p.a.	20,56 %	8,58 %
Längste Verlustperiode	7,31 J.	1,80 J.
Rendite zu Risiko		
Rendite / Max. Rückgang	0,05	0,78
Rendite / Mittel Rückgang	0,18	4,40
Rendite / Volatilität p.a.	0,19	1,51

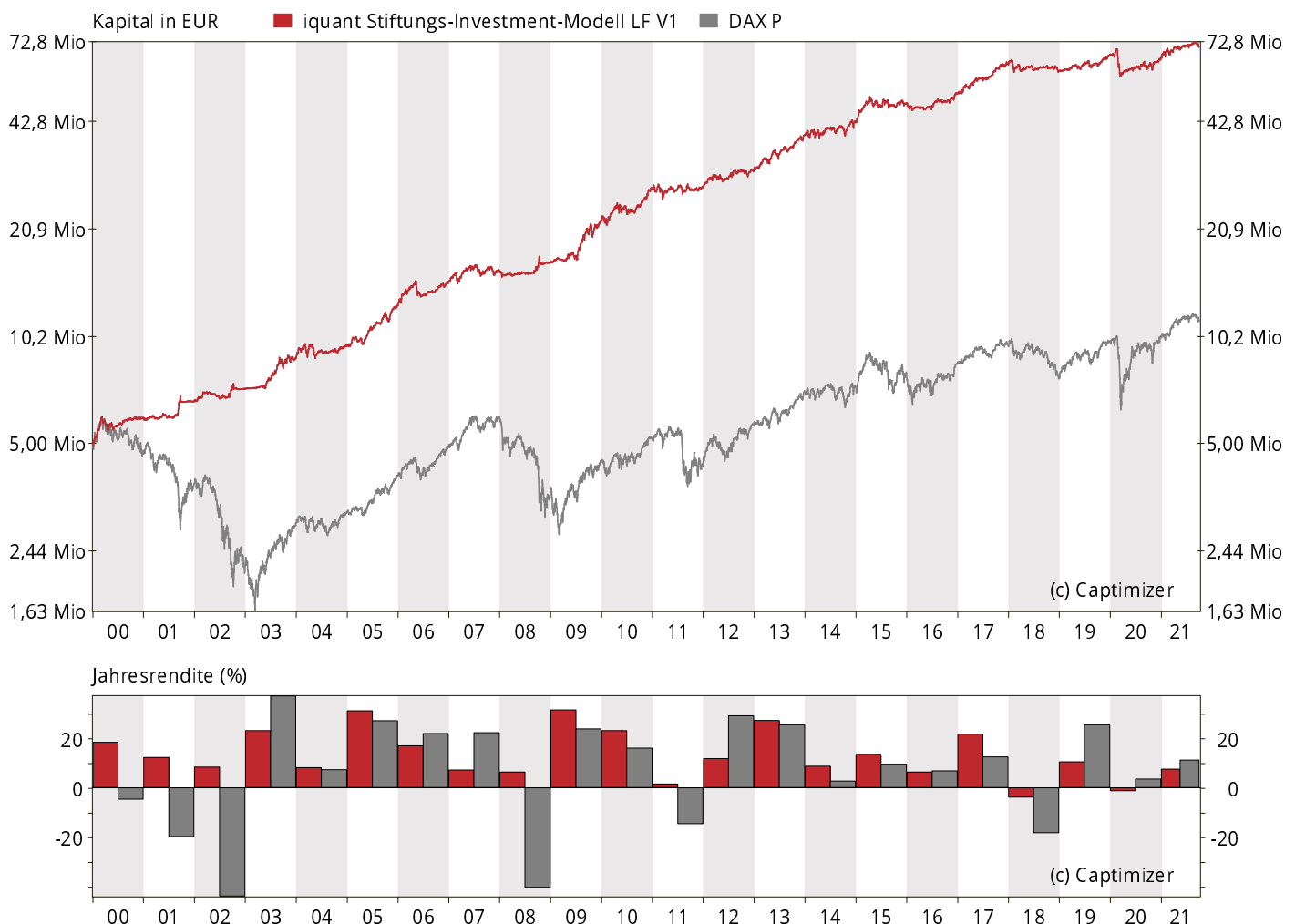
Beschreibung

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

Jahres- renditen (%)	Monatsrenditen (%)												
	Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	
2000	18,44	3,79	11,75	-0,61	-2,22	-2,32	1,75	1,81	2,63	0,75	0,31	0,65	-0,53
2001	12,21	-0,39	0,86	-0,36	0,15	1,78	-0,33	-1,51	2,05	8,94	-0,10	0,51	0,38
2002	8,32	2,28	1,54	2,05	-1,33	-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	5,35	5,52	-3,44	7,62	-0,94	1,06
2004	8,12	5,42	1,84	-1,83	0,71	-3,40	2,55	-1,01	-0,08	0,14	0,47	1,31	1,99
2005	31,07	1,52	3,33	-1,23	-2,13	7,22	3,15	3,56	0,43	6,40	-3,69	6,66	2,80
2006	17,00	6,67	3,10	1,96	2,21	-5,53	-1,39	1,36	1,32	0,96	2,23	0,48	2,88
2007	7,18	3,24	-1,42	1,83	3,94	2,83	-1,14	-1,15	-1,67	1,54	2,27	-3,70	0,69
2008	6,40	-2,52	0,66	-0,87	0,80	1,01	-0,06	-0,45	0,32	3,93	2,03	1,45	0,06
2009	31,49	1,62	0,40	-0,75	1,35	2,36	-1,45	6,96	6,83	4,71	-3,18	4,55	4,88
2010	23,06	-1,23	2,29	6,12	1,88	-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	2,18	0,24	-0,35	0,63	-2,20	0,36	-0,07	1,65	0,38
2012	11,77	3,40	2,96	1,06	0,67	-2,43	0,99	3,30	0,02	0,89	-0,95	0,91	0,52
2013	27,22	1,82	4,37	1,96	0,54	3,67	-1,52	3,82	-1,48	3,01	3,86	3,00	1,48
2014	8,68	-0,05	2,98	-0,86	-1,07	2,96	0,10	-1,02	1,51	0,66	-0,31	3,91	-0,30
2015	13,53	6,90	4,35	2,16	-1,43	1,30	-2,45	3,65	-1,99	-0,55	1,11	1,99	-1,83
2016	6,31	-1,85	-1,06	-0,01	-0,64	0,97	0,89	3,36	-0,18	0,43	-0,13	1,50	2,98
2017	21,66	0,47	4,47	1,62	1,66	1,83	-0,58	0,82	2,55	3,62	2,33	0,43	0,65
2018	-3,88	1,46	-2,64	-2,23	0,36	1,00	-1,07	-0,05	1,52	0,70	-0,83	0,76	-2,81
2019	10,47	0,43	-0,17	1,65	1,84	-2,85	3,02	1,87	-1,47	0,84	0,77	3,09	1,13
2020	-1,31	-0,99	-6,57	-3,85	1,73	1,14	1,22	-1,51	3,88	-1,77	-2,18	5,09	3,11
2021	7,59	0,70	1,28	3,88	0,67	0,58	1,22	-0,04	1,75	-2,58			
Mittelwert	13,18	1,44	1,68	0,43	0,58	0,55	0,19	1,42	0,92	1,87	0,69	1,74	1,10