

iquant Stiftungs-Investment-Modell 50 V1

Basisdaten		
Outperformance	816 % (7,58 % p.a.)	
Transaktionen	3353 (150,6 p.a.)	
Benchmark	DAX P	
	Benchmark	Strategie
Kapital		
Start 01/2000	50.000.000 EUR	50.000.000 EUR
Ende 03/2022	106.763.905 EUR	514.642.378 EUR
Rendite		
Rendite p.a. (geo.)	3,47 %	11,04 %
Rendite 2021	15,79 %	8,70 %
Rendite 2022 YTD	-9,25 %	-6,33 %
Risiko		
Maximaler Rückgang	-72,68 %	-14,03 %
Mittlerer Rückgang	-20,99 %	-2,56 %
Volatilität p.a.	20,44 %	7,25 %
Längste Verlustperiode	7,31 J.	1,67 J.
Rendite zu Risiko		
Rendite / Max. Rückgang	0,05	0,79
Rendite / Mittel Rückgang	0,17	4,32
Rendite / Volatilität p.a.	0,17	1,52

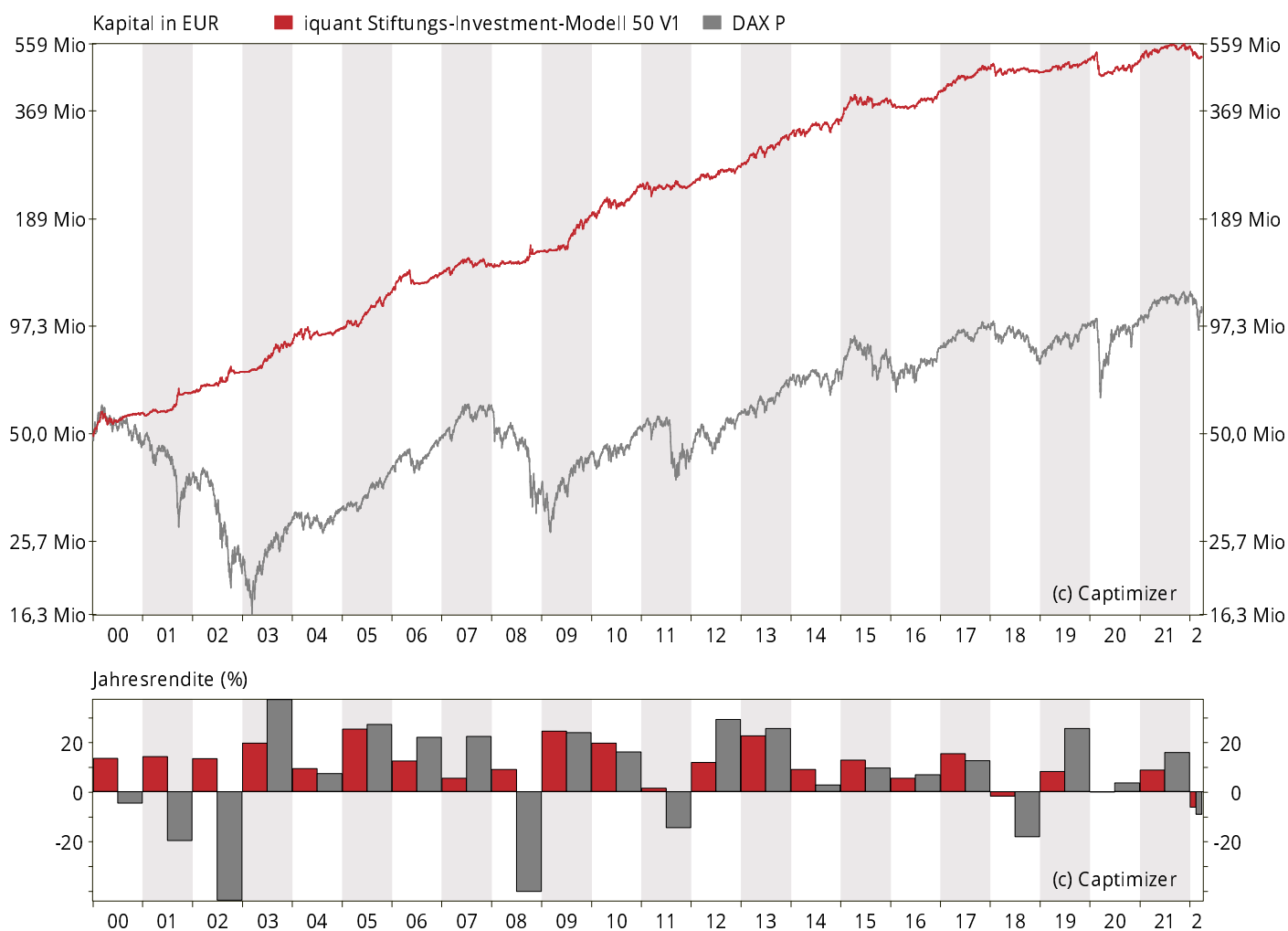
Beschreibung

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.



iquant Stiftungs-Investment-Modell 50 V1

	Jahresrenditen (%)	Monatsrenditen (%)											
		Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez
2000	13,42	3,00	8,87	-0,59	-1,64	-2,41	0,83	1,51	1,95	0,88	0,03	1,14	-0,48
2001	14,13	-1,18	2,05	0,98	-1,10	0,59	0,44	0,42	3,33	6,28	0,81	0,14	0,73
2002	13,27	1,43	0,93	2,09	0,11	-0,56	0,62	2,50	-0,82	8,28	-1,51	-0,89	0,69
2003	19,55	0,05	0,67	0,77	0,67	3,06	1,99	4,19	4,14	-2,94	4,93	-0,46	1,19
2004	9,34	5,02	2,18	-1,40	0,81	-1,36	2,33	-2,28	0,59	0,45	-0,40	1,67	1,56
2005	25,25	1,85	2,10	-0,66	-1,89	5,28	3,07	4,32	0,36	4,71	-2,73	4,67	2,02
2006	12,36	5,73	2,99	1,86	0,99	-4,25	-1,40	-0,14	0,58	1,60	1,46	0,78	1,81
2007	5,40	1,76	-1,10	2,11	2,47	2,97	-0,16	-0,55	-1,60	0,94	2,36	-3,54	-0,18
2008	8,92	-0,60	0,63	1,41	-0,08	0,00	0,24	-0,36	0,67	2,57	2,54	1,27	0,35
2009	24,44	-0,22	1,01	-0,34	1,13	0,73	0,19	6,75	3,19	4,27	-2,41	4,29	3,85
2010	19,62	-0,44	2,66	5,86	1,17	-1,60	-1,02	0,12	0,32	3,49	3,07	2,17	2,51
2011	1,41	-1,09	1,70	-1,85	1,35	0,42	-0,32	-0,11	0,17	0,83	-1,66	0,17	1,86
2012	11,83	1,26	2,13	2,19	0,83	-1,45	0,26	3,08	-0,03	0,61	-0,47	2,03	0,87
2013	22,54	1,77	3,52	2,78	0,68	1,84	-2,35	3,87	-1,14	3,63	3,58	1,75	0,77
2014	8,93	-0,24	3,20	-1,08	-0,65	3,73	0,83	-1,68	1,97	0,13	-0,68	3,16	0,07
2015	12,72	6,29	4,50	2,32	-2,36	2,51	-3,01	2,97	-2,85	0,10	1,36	2,03	-1,34
2016	5,37	-2,39	-1,30	-0,08	-0,64	0,71	0,54	2,97	0,76	1,16	-1,13	1,52	3,28
2017	15,37	0,91	3,04	2,47	1,25	1,90	-1,65	1,33	1,39	2,54	2,39	-0,88	-0,20
2018	-1,94	1,38	-2,27	-2,04	0,18	1,33	-0,62	1,05	1,56	-0,38	-1,06	0,06	-1,05
2019	8,10	0,48	-0,03	1,88	1,64	-2,39	2,27	1,43	-0,76	0,64	-0,09	2,00	0,85
2020	-0,25	-0,43	-5,20	-3,76	1,16	0,59	1,16	-0,30	2,47	-0,73	-2,40	5,57	2,06
2021	8,70	1,09	1,10	3,22	0,32	0,92	1,33	0,70	0,64	-2,30	0,77	-1,21	1,89
2022	-6,33	-3,77	-1,81	-0,87									
Mittelwert	10,96	0,94	1,37	0,75	0,29	0,57	0,25	1,45	0,77	1,67	0,40	1,25	1,05