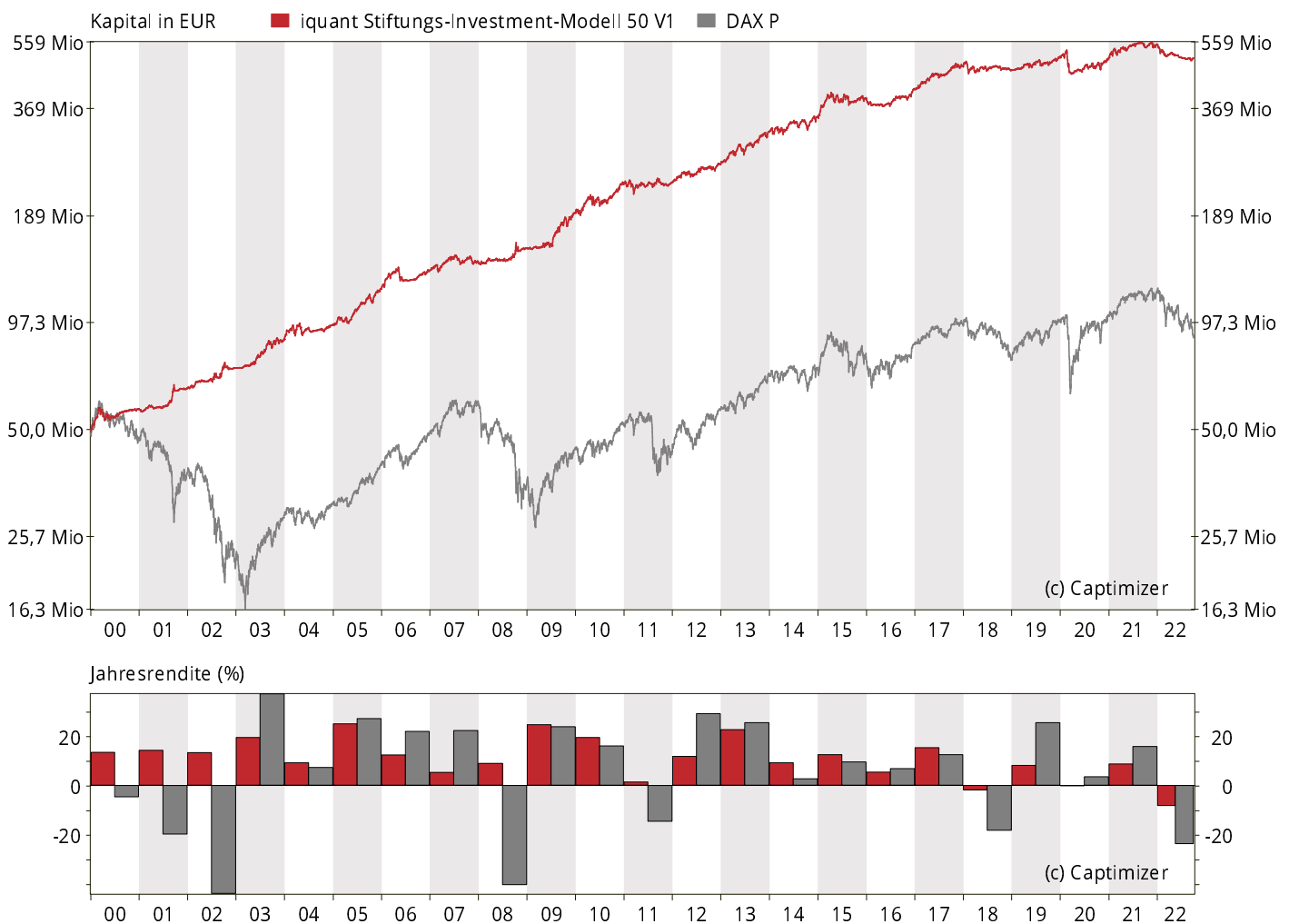


# iquant Stiftungs-Investment-Modell 50 V1

Basisdaten		Beschreibung	
Outperformance	830 % (8,09 % p.a.)	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.	
Transaktionen	3383 (148,6 p.a.)		
Benchmark	DAX P		
	Benchmark	Strategie	
Kapital		Subsysteme:	
Start 01/2000	50.000.000 EUR	50.000.000 EUR	1. Dividende D + US (15%)
Ende 09/2022	89.725.898 EUR	504.503.847 EUR	2. Relative Stärke Deutschland (10%)
Rendite		3. Trendfolge Deutschland (10%)	
Rendite p.a. (geo.)	2,60 %	10,69 %	4. Trendfolge Global (10%)
Rendite 2021	15,79 %	8,67 %	5. Trendfolge Renten Deutschland (20%)
Rendite 2022 YTD	-23,74 %	-8,22 %	6. Saisonal Deutschland (10%)
Risiko		7. Technologie-Mix (NASDAQ100) (10%)	
Maximaler Rückgang	-72,68 %	-14,03 %	8. Branchenrotation Europa (10%)
Mittlerer Rückgang	-20,91 %	-2,70 %	
Volatilität p.a.	20,47 %	7,20 %	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.
Längste Verlustperiode	7,31 J.	1,67 J.	Die Liquidität wird im Geldmarkt zum Eonia-Geldmarktsatz angelegt.
Rendite zu Risiko			
Rendite / Max. Rückgang	0,04	0,76	
Rendite / Mittel Rückgang	0,12	3,96	
Rendite / Volatilität p.a.	0,13	1,48	



# iquant Stiftungs-Investment-Modell 50 V1

Jahres- renditen (%)	Monatsrenditen (%)												
	Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	
2000	13,40	3,00	8,87	-0,58	-1,64	-2,41	0,82	1,51	1,95	0,89	0,02	1,15	-0,48
2001	14,24	-1,18	2,06	0,99	-1,10	0,59	0,44	0,42	3,34	6,28	0,88	0,15	0,75
2002	13,31	1,39	0,94	2,11	0,13	-0,55	0,64	2,46	-0,82	8,28	-1,48	-0,88	0,69
2003	19,51	0,05	0,63	0,77	0,69	2,97	1,99	4,21	4,12	-2,92	4,94	-0,43	1,20
2004	9,17	5,03	2,21	-1,38	0,83	-1,40	2,27	-2,36	0,53	0,47	-0,43	1,69	1,55
2005	25,01	1,85	2,04	-0,68	-1,90	5,29	3,05	4,31	0,39	4,65	-2,78	4,68	2,02
2006	12,36	5,72	2,99	1,84	1,01	-4,24	-1,39	-0,14	0,58	1,60	1,46	0,78	1,81
2007	5,32	1,76	-1,10	2,07	2,54	3,00	-0,22	-0,63	-1,60	0,95	2,36	-3,54	-0,18
2008	9,01	-0,52	0,63	1,41	-0,08	0,00	0,24	-0,36	0,67	2,57	2,54	1,27	0,34
2009	24,59	-0,22	1,01	-0,34	1,13	0,73	0,19	6,75	3,18	4,27	-2,36	4,39	3,83
2010	19,49	-0,42	2,64	5,85	1,17	-1,60	-1,02	0,12	0,31	3,50	3,04	2,11	2,48
2011	1,46	-1,13	1,67	-1,78	1,34	0,44	-0,31	-0,07	0,14	0,82	-1,64	0,17	1,86
2012	11,80	1,27	2,13	2,20	0,83	-1,46	0,26	3,08	-0,02	0,60	-0,47	2,01	0,87
2013	22,69	1,77	3,52	2,79	0,68	1,83	-2,35	3,86	-1,13	3,63	3,58	1,82	0,81
2014	9,23	-0,37	3,15	-1,15	-0,61	3,79	0,80	-1,62	2,17	0,09	-0,61	3,34	0,07
2015	12,54	6,27	4,40	2,37	-2,42	2,56	-3,00	2,98	-2,86	0,06	1,32	1,97	-1,29
2016	5,45	-2,34	-1,32	-0,11	-0,67	0,72	0,50	3,04	0,71	1,15	-0,97	1,42	3,36
2017	15,33	0,84	3,03	2,56	1,25	1,88	-1,66	1,33	1,39	2,53	2,39	-0,87	-0,20
2018	-1,93	1,43	-2,26	-1,99	0,21	1,20	-0,59	1,01	1,58	-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	-0,24	-0,42	-5,20	-3,76	1,16	0,59	1,16	-0,29	2,47	-0,72	-2,40	5,57	2,06
2021	8,67	1,09	1,10	3,22	0,32	0,92	1,33	0,70	0,64	-2,30	0,77	-1,21	1,87
2022	-8,22	-3,77	-1,81	-0,86	0,47	-0,63	-1,31	-0,81	0,33	-0,07			
Mittelwert	10,88	0,94	1,36	0,76	0,30	0,51	0,18	1,34	0,75	1,59	0,41	1,26	1,06