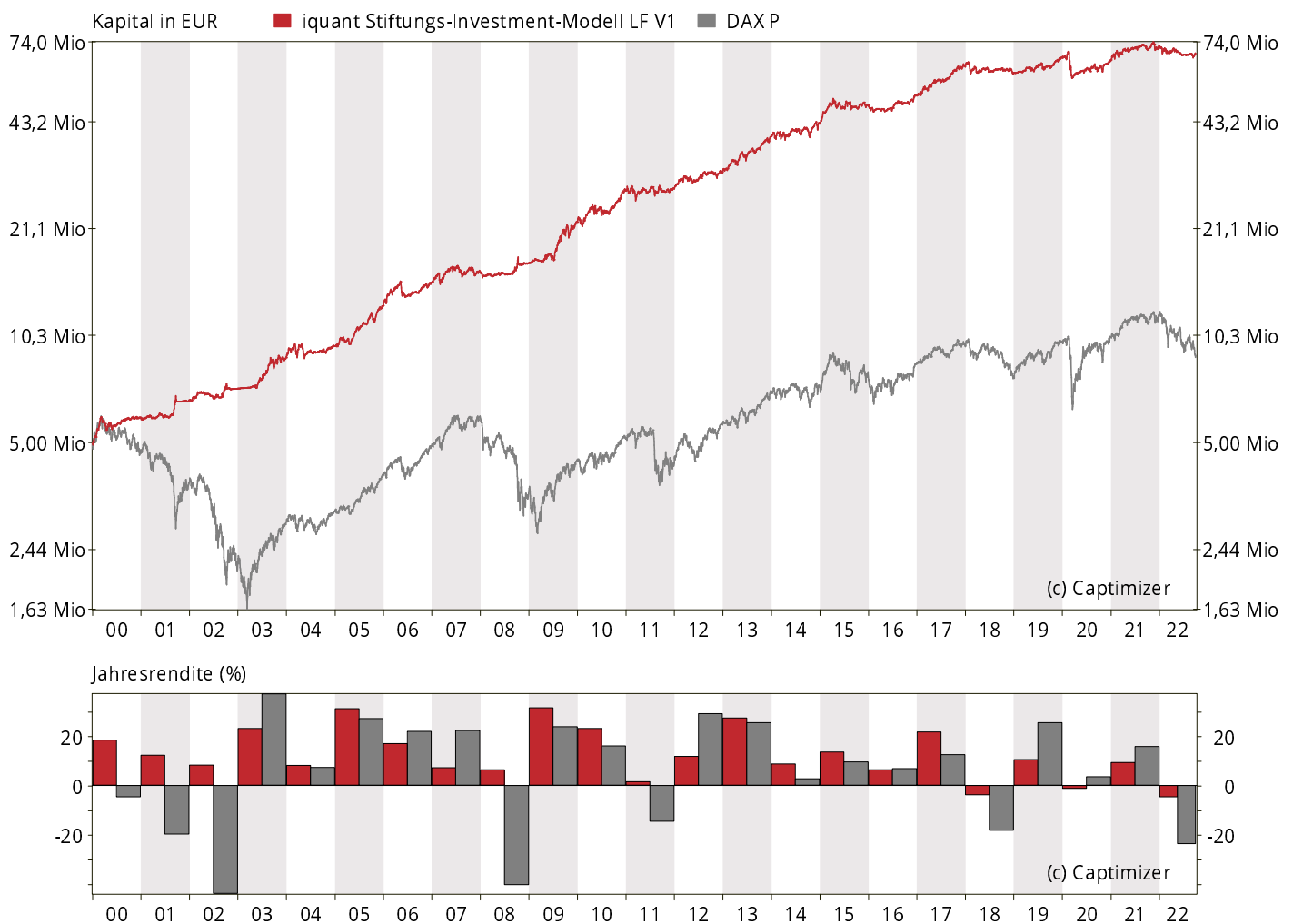


iquant Stiftungs-Investment-Modell LF V1

Basisdaten				Beschreibung	
Outperformance		1.184 % (9,56 % p.a.)		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.	
Transaktionen		659 (29,0 p.a.)			
Benchmark		DAX P			
		Benchmark	Strategie		
Kapital				Subsysteme:	
Start 01/2000	5.000.000 EUR	5.000.000 EUR		1. Dividendestrategie mit 5 DAX-Aktien (15%)	
Ende 09/2022	8.972.590 EUR	68.181.435 EUR		2. Dividendestrategie mit 5 Dow-Aktien (15%)	
Rendite				3. Relative-Stärke-Strategie mit 5 HDaX-Aktien (15%)	
Rendite p.a. (geo.)	2,60 %	12,16 %		4. Saisonal Deutschland mit 1 ETF (10%)	
Rendite 2021	15,79 %	9,31 %		5. MakroTrend Deutschland Small- und MidCaps mit SDAX- und MDAX-ETF (10%)	
Rendite 2022 YTD	-23,74 %	-4,76 %		6. Globale Trendfolge Industrieländer mit MSCI World ETF (5%)	
Risiko				7. Globale Trendfolge Schwellenländer mit MSCI EM ETF (5%)	
Maximaler Rückgang	-72,68 %	-16,58 %		8. Trendfolge Technologie mit NASDAQ100-ETF (10%)	
Mittlerer Rückgang	-20,91 %	-3,06 %		9. Trendfolge mit Gold-ETF (10%)	
Volatilität p.a.	20,47 %	8,52 %		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.	
Längste Verlustperiode	7,31 J.	1,80 J.			
Rendite zu Risiko					
Rendite / Max. Rückgang	0,04	0,73			
Rendite / Mittel Rückgang	0,12	3,97			
Rendite / Volatilität p.a.	0,13	1,43			



iquant Stiftungs-Investment-Modell LF V1

	Jahresrenditen (%)	Monatsrenditen (%)											
		Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez
2000	18,42	3,79	11,74	-0,60	-2,22	-2,32	1,74	1,80	2,64	0,76	0,29	0,67	-0,54
2001	12,21	-0,39	0,85	-0,35	0,14	1,78	-0,34	-1,52	2,05	8,94	-0,10	0,50	0,38
2002	8,27	2,23	1,55	2,05	-1,32	-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	7,63	-0,94	1,06
2004	8,12	5,42	1,84	-1,83	0,71	-3,41	2,56	-1,03	-0,08	0,15	0,47	1,31	1,99
2005	31,12	1,54	3,32	-1,22	-2,13	7,21	3,16	3,55	0,47	6,39	-3,68	6,65	2,80
2006	16,99	6,66	3,10	1,96	2,21	-5,53	-1,39	1,36	1,32	0,96	2,23	0,48	2,88
2007	7,17	3,24	-1,42	1,83	3,95	2,83	-1,15	-1,15	-1,68	1,55	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	31,47	1,62	0,40	-0,75	1,34	2,36	-1,45	6,95	6,82	4,71	-3,18	4,55	4,87
2010	23,10	-1,19	2,29	6,11	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	-2,44	2,19	0,24	-0,35	0,63	-2,20	0,36	-0,07	1,65	0,38
2012	11,76	3,40	2,95	1,06	0,67	-2,43	0,99	3,29	0,03	0,88	-0,94	0,91	0,52
2013	27,36	1,83	4,36	1,97	0,54	3,66	-1,52	3,82	-1,48	3,01	3,87	3,05	1,55
2014	8,74	-0,20	2,91	-0,90	-0,98	3,03	0,05	-1,02	1,73	0,66	-0,31	3,90	-0,30
2015	13,54	6,91	4,36	2,17	-1,44	1,30	-2,45	3,64	-1,99	-0,55	1,10	1,99	-1,83
2016	6,31	-1,85	-1,06	-0,01	-0,64	0,97	0,89	3,36	-0,18	0,42	-0,13	1,50	2,98
2017	21,63	0,47	4,47	1,62	1,72	1,77	-0,60	0,81	2,55	3,62	2,33	0,43	0,65
2018	-3,96	1,46	-2,64	-2,23	0,36	1,00	-1,15	-0,05	1,53	0,70	-0,83	0,76	-2,82
2019	10,47	0,43	-0,16	1,65	1,84	-2,85	3,02	1,87	-1,47	0,84	0,77	3,08	1,14
2020	-1,28	-0,99	-6,57	-3,85	1,73	1,14	1,22	-1,50	3,88	-1,74	-2,18	5,09	3,11
2021	9,31	0,71	1,28	3,88	0,67	0,58	1,22	-0,04	1,75	-2,57	1,79	-2,59	2,46
2022	-4,76	-2,15	-0,52	-1,19	1,55	-1,86	-1,22	0,08	0,26	0,24			
Mittelwert	12,48	1,28	1,58	0,36	0,63	0,44	0,12	1,36	0,90	1,80	0,74	1,54	1,17