

iQ-FOXX smart BETA Modell-Portfolio - Konservativ

Aktuelle Signale: 3 Risk ON | 7 Risk OFF

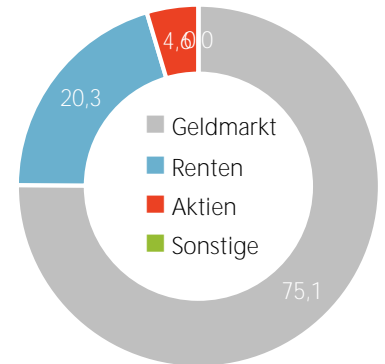
Unsere Philosophie: Ein intelligentes Index-Konzept

iQ-FOXX ist ein international tätiger Indexanbieter. Die Produktpalette umfasst über 350 regelbasierte Indizes, die von Fondsgesellschaften und Vermögensverwaltern für Fonds, strukturierte und Multi-Asset Produkte sowie Managed Accounts genutzt werden. Der Gründer und CEO Dr. Miro Mitev entwickelt die Indexkonzepte seit dem Jahr 2000. Zu Beginn als Head of Portfolio Management bei der Siemens AG, später bei der C-QUADRAT Kapitalanlage AG. Die Indizes werden seit 2007 eingesetzt und aktuell sind rund 800 Mio. EUR auf Basis der Indizes allokiert.

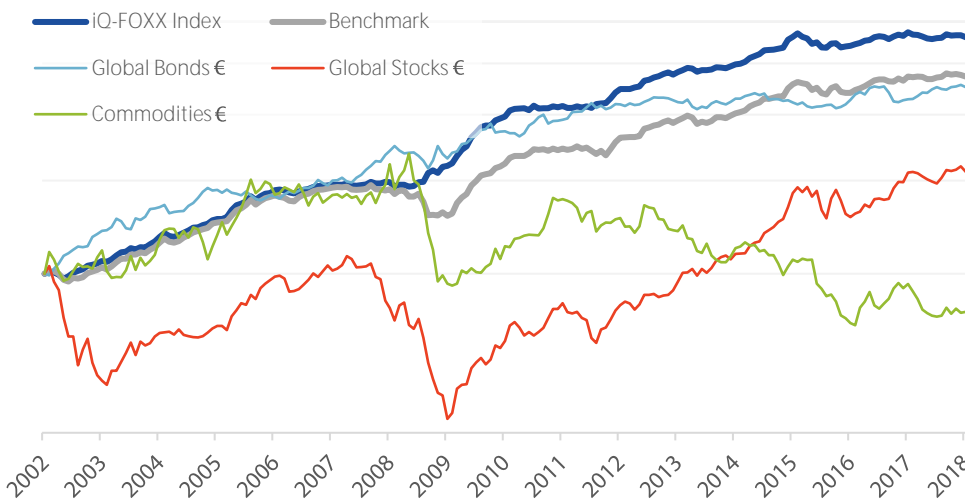
Portfolios mit iQ-FOXX Inizes individuell erstellen, optimieren & überwachen

Erstellen Sie dynamische, kosteneffiziente und täglich liquide Portfolios. Auf Basis der Zieldefinition wird die strategische Anlagestruktur festgelegt. iQ-FOXX optimiert die Gewichtung und basierend auf den iQ-FOXX Indizes wird jedes einzelne Anlageinstrument auf täglicher Basis überprüft.

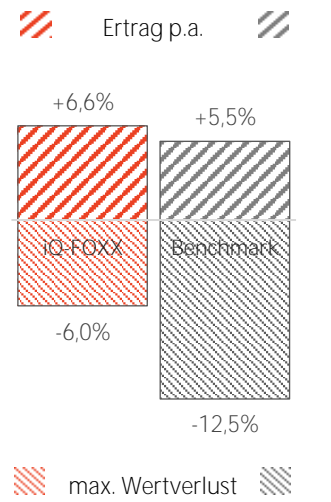
Aktuelle Gewichtung (%)



Wertentwicklung



Risiko/Ertrags-Analyse

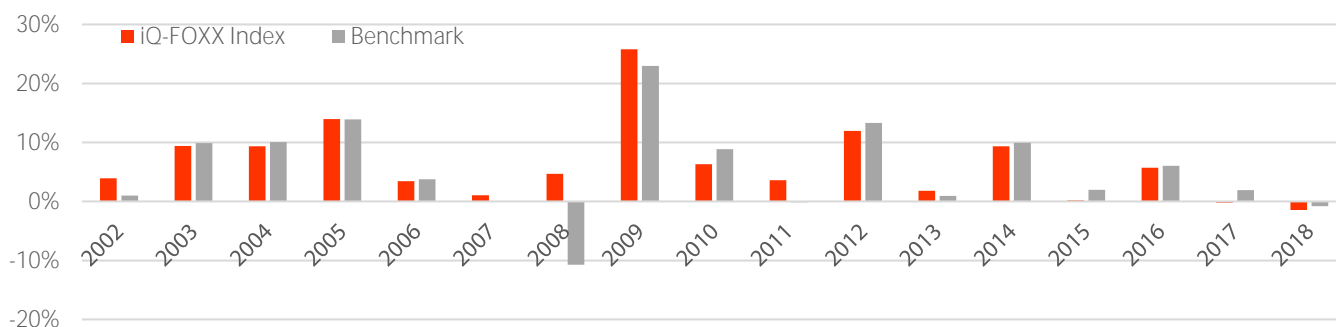


Monatliche Performance

Jahr	Jän	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	Gesamt	(%)	iQ-FOXX Benchmark											
2018	-0,1	-0,3	-0,9	-0,7	-0,5	0,3							-1,5	-0,8												
2017	-0,6	-1,0	1,6	1,9	-1,0	-0,3	-0,1	0,2	-0,7	-0,2	-0,9	-0,9	-0,2	0,0	0,3	0,7	0,3	0,2	1,4	1,6	-0,5	-0,5	0,2	0,2	-0,2	1,9
2016	0,4	-0,4	0,3	-0,1	0,7	1,4	0,5	0,6	1,0	1,0	0,3	1,4	1,2	1,2	0,5	0,5	-0,3	0,0	-0,9	-0,8	1,0	-0,3	0,9	1,5	5,7	6,1
2015	3,4	3,5	1,3	1,8	1,5	1,1	-1,4	-0,6	-0,7	-0,5	-2,4	-2,4	0,8	0,9	-2,3	-2,3	-0,1	-0,6	1,8	2,9	0,2	0,8	-1,8	-2,4	0,2	2,0
2014	0,8	1,1	0,8	1,1	0,3	0,5	0,8	0,8	1,7	1,8	0,9	0,9	0,8	0,8	1,7	1,8	0,2	-0,2	0,2	0,5	0,4	0,6	0,4	0,0	9,3	10,0
2013	-1,0	-1,1	1,1	1,1	0,9	1,0	1,0	1,1	-0,3	-0,8	-1,4	-2,7	0,7	1,0	0,0	-0,6	0,3	0,9	0,9	1,6	-0,1	0,0	-0,3	-0,4	1,8	0,9
2012	2,5	3,0	1,6	2,0	-0,1	0,1	0,1	0,2	0,7	-0,1	0,5	0,5	2,6	3,3	0,3	0,5	1,0	0,9	0,5	0,3	1,1	1,2	0,7	0,7	12,0	13,3
2011	-0,5	-0,7	0,6	0,7	-0,8	-0,6	0,0	0,4	0,7	1,1	-0,5	-1,0	0,6	0,6	-0,7	-1,4	1,7	-1,3	0,3	1,4	0,1	-2,0	2,2	2,8	3,6	-0,1
2010	0,8	0,7	0,9	1,2	2,6	2,7	0,7	0,8	0,2	0,1	0,1	0,0	-0,9	1,0	2,1	1,8	-1,2	-0,2	0,1	0,2	0,0	-0,6	0,8	0,9	6,3	8,9
2009	2,7	1,4	0,4	-1,5	1,1	1,0	3,3	4,6	2,7	2,5	1,5	1,6	4,1	3,9	2,0	1,8	2,5	2,5	0,6	0,6	0,1	0,5	2,3	2,2	25,8	23,0
2008	0,7	-0,4	-0,1	0,5	-1,7	-2,1	0,6	1,6	0,0	-0,2	-0,8	-2,4	0,3	-0,1	1,7	1,3	0,1	-3,4	4,0	-5,8	1,1	0,1	-1,1	-0,3	4,7	-11,0
2007	0,2	0,3	0,2	0,4	0,0	0,3	0,0	-0,1	0,6	0,2	-0,9	-1,2	-0,1	-0,2	0,3	0,2	0,3	0,3	1,0	1,6	-0,7	-1,8	0,0	-0,1	1,0	0,0
2006	0,3	0,4	1,3	0,7	0,2	-0,6	-0,4	-0,5	-0,9	-1,3	-0,4	-0,2	0,8	1,9	0,7	1,0	0,4	0,5	0,9	1,2	0,4	0,5	0,1	0,2	3,5	3,8
2005	1,5	2,0	0,6	0,4	0,1	0,2	0,8	0,3	3,1	2,6	2,2	2,2	0,7	0,8	0,9	1,5	2,3	2,3	-1,5	-2,1	1,5	1,5	1,2	1,4	14,0	13,9

iQ-FOXX smart BETA Modell-Portfolio - Konservativ

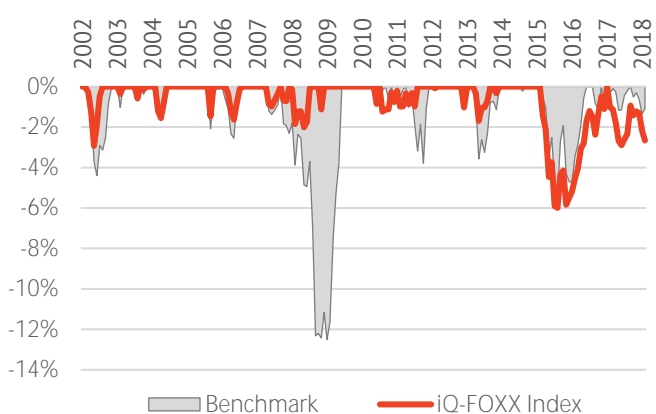
Jährliche Performance



Kennzahlen

02.2002 – 03.2018	iQ-FOXX Index	Benchmark	Anleihen weltweit	Aktien weltweit	Rohstoffe	Netto Performance	iQ-FOXX Index	Benchmark
Gesamtpformance	178,7%	136,8%	128,2%	51,0%	-16,6%	YTD	-1,5%	-0,8%
Performance p.a.	6,6%	5,5%	5,3%	2,6%	-1,1%	1 Jahr	-1,7%	0,6%
Sharpe Ratio	1,76	1,19	0,93	0,20	-0,08	3 Jahre p.a.	-0,7%	0,9%
Schlechtestes Monat	-2,4%	-5,8%	-3,9%	-11,8%	-12,8%	5 Jahre p.a.	2,8%	3,7%
Volatilität p.a.	3,7%	4,6%	5,7%	13,2%	14,1%	7 Jahre p.a.	4,4%	4,7%
max. Wertverlust	-6,0%	-12,5%	-9,4%	-50,8%	-52,7%	10 Jahre p.a.	6,6%	5,3%
Längste Erholungsphase	22 Monate	21 Monate	21 Monate	78 Monate	117 Monate	15 Jahre p.a.	6,7%	5,8%

max. Wertverlust



Korrelation des iQ-FOXX Muster-Portfolios zu:

Benchmark Portfolio	0,71
Anleihen weltweit	-0,08
Aktien weltweit	0,47
Rohstoffe	0,26

Beta des iQ-FOXX Muster-Portfolios zu(r):

Benchmark Portfolio	0,58
Anleihen weltweit	-0,05
Aktien weltweit	0,13
Rohstoffe	0,07

Portfolio

Signal 1 = Risk ON Signal 0 = Risk OFF		
Anlageklasse	0/1	Gewichtung
Geldmarkt		75,1%
Staatsanleihen Europa	0	0,0%
Anleihen Inflationsgeschützt	1	10,3%
Anleihen Emerging Markets	0	0,0%
Euro Untern.anleihen/gute Bonität	0	0,0%
Euro Untern.anleihen/geringe Bonität	1	10,0%
Deutsche Pfandbriefe	0	20,3%
Aktien weltweit	1	4,6%
Aktien Emerging Markets	0	4,6%
Immobilien	0	0,0%
Rohstoffe ohne Landwirtschaft	0	0,0%

■ Renten ■ Aktien ■ Sonstige

 iQ-FOXX Indices Ltd. » Lugeck 6 » 1010 Vienna » Austria » www.iq-foxx.com » Bloomberg: FOXX <GO> » www.privemanagers.com

Die Nutzung der iQ-FOXX Indizes sowie der beispielhaften Muster Portfolios und die Nutzung der entsprechenden Indexdaten für Finanzprodukte oder zu anderen Zwecken bedürfen einer Lizenz von iQ-FOXX Indices Ltd. Mit der Veröffentlichung von Indizes sowie der beispielhaften Muster Portfolios bzw. im Zusammenhang mit dieser leistet iQ-FOXX Indices Ltd. keine Anlageberatung. Finanzinstrumente, die auf iQ-FOXX-Indizes basieren, werden in keiner Weise von iQ-FOXX Indices Ltd. gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. © iQ-FOXX Indices Ltd. Alle Rechte vorbehalten.

iQ-FOXX smart BETA Modell-Portfolio - Konservativ

Anlageklasse	ETF	ISIN
Geldmarkt	db x-trackers EONIA UCITS ETF 1C	LU0290358497
Staatsanleihen Europa	ISHARES CORE EURO GOVERNMENT BOND (DE) UCITS ETF	DE000A0YBRZ7
Anleihen Inflationsgeschützt	iShares Euro Inflation Linked Gov. Bond UCITS ETF	IE00B0M62X26
Anleihen Emerging Markets	iShares J.P. Morgan Emerging Markets Bond UCITS ETF	DE000A0RFFT0
Euro Untern.anleihen/gute Bonität	iShares Core Euro Corporate Bond UCITS ETF	IE00B3F81R35
Euro Untern.anleihen/geringe Bonität	iShares Euro High Yield Corporate Bond UCITS ETF	IE00B66F4759
Deutsche Pfandbriefe	Deka iBoxx EUR Liquid Germany Covered Bonds UCITS ETF	DE000ETF1359
Aktien weltweit	iShares Core MSCI World UCITS ETF	IE00B4L5Y983
Aktien Emerging Markets	iShares Core MSCI Emerging Markets UCITS ETF	IE00BKM4GZ66
Immobilien	db x-trackers FTSE EPRA/NAREIT Developed Europe Real Estate UCITS ETF	LU0489337690
Rohstoffe ohne Landwirtschaft	ETFS Ex-Agriculture & Livestock UCITS ETF	DE000A1RX1P2

■ Renten ■ Aktien ■ Sonstige

