

## Risikoreduzierte Indexstrategien mit dem Blick nach Vorne

**Ziel » positive Benchmark-Performance | positive Outperformance** in fallenden Märkten

**für Ihr Portfolio » Verlustrisiko reduzieren**

**FOXX-Faktor » Prognosealgorithmus** zur Bestimmung zukünftiger Entwicklungen an Aktien-, Anleihen, Rohstoff- und Devisenmärkten

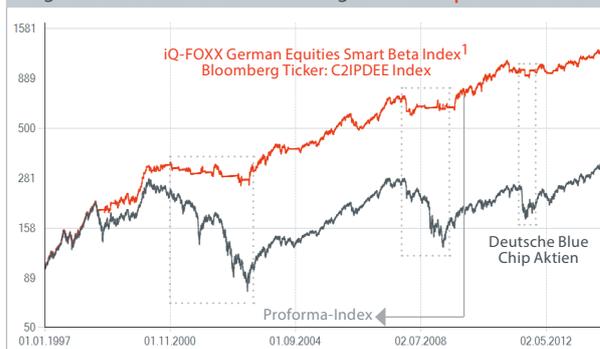
### Indexstile:

**smart BETA Index = Long oder Cash**

**enhanced BETA Index = Long mit Hebel oder Cash**

**ALPHA Index = Short oder Long mit Hebel oder Cash**

### Prognosebasierte smart BETA Strategie » Aktien | Deutschland



Quelle: iQ-FOXX, Bloomberg

Jahreskennziffern (live)	2010	2011	2012	2013
Performance p.a.	26,75	-5,99	10,85	6,12
Volatilität p.a.	17,52	14,69	12,2	1,38

## iQ-FOXX Indexmethodik

Ein Index, der die Zukunft bereits heute berücksichtigt

**iQ » intelligent konzipierte Indexkonstruktion** durch Verwendung gegenwärtiger Marktinformationen (makroökonomische, fundamentale und technische Faktoren)

**F für Forecast » Berücksichtigung von Prognosen zukünftiger** Marktentwicklungen in der heutigen Indexgewichtung (Prognose-Indikatoren)

wichtig: **Risikobegrenzung** als übergeordnetes Kriterium bei der Indexgewichtung (KO-Kriterium)

**O für Optimised » Optimierung der Indexgewichtung auf Basis relevanter Informationen** aus Gegenwart und Zukunft entsprechend dem jeweiligen Indexstil **smart BETA | enhanced BETA | ALPHA**

**XX für Index » besseres Rendite-Risiko-Verhältnis** durch prognosebasierten iQ-FOXX Index

makroökonomische,  
fundamentale und  
technische Faktoren

» Prognose-Indikatoren  
der Marktentwicklung

» Risikobegrenzung  
(KO-Kriterium)

» smart BETA  
enhanced BETA  
ALPHA  
Faktoren

» **iQ-FOXX  
prognosebasierter  
Index**

## iQ-FOXX für Ihr Portfolio

**iQ-FOXX Direktlizenz »** Lizenzierung von iQ-FOXX Prognose-Indikatoren als Ergänzungsbaustein in der Asset Allokation und in Portfolio Management Modellen

**Indexlizenz erwerben »** Lizenzierung von iQ-FOXX Indizes als Benchmark und Basis für ETFs, Index-Zertifikate, Managed Accounts, Fondsgebundene und andere Produkte

**Replizierten Index erwerben »** Information zur Indexnachbildung mit ETFs oder über ein Managed Account

### Bei Fragen sprechen Sie uns an!

Für Ihre Rückfragen:

**Mag. Roland Meier**

Geschäftsführer iQ-FOXX Indices Ltd., Wien

Telefon: +43 (0) 1 688 37 66

Direkt: +43 (0) 699 182 598 67

E-Mail: roland.meier@iq-foxx.com

**Lizenzfreie Informationen** erhalten Sie unter:

Internet: [www.iq-foxx.com](http://www.iq-foxx.com)

Bloomberg: FOXX <GO>

## smart BETA Indexstrategien für Ihr Portfolio Intelligente risikoreduzierte Indexkonzepte für alle Assetklassen

**Unternehmen** » weltweit tätiger, **unabhängiger** Indexanbieter spezialisiert auf Smart Beta Strategien, die zukünftige Marktentwicklungen zusätzlich in der aktuellen Indexzusammensetzung berücksichtigen

**Indextechnologie** » Entwicklung seit 2000 mit mehr als **14-jährigem Live-Research** und in praktischer Anwendung seit mehr als 6 Jahren

**Indexpalette** » **200 Indizes** decken alle wesentlichen Assetklassen, Regionen und aktuellen Themen ab

### Aktien Weltweit

**Strategie** » smart BETA | Aktien | Weltweit

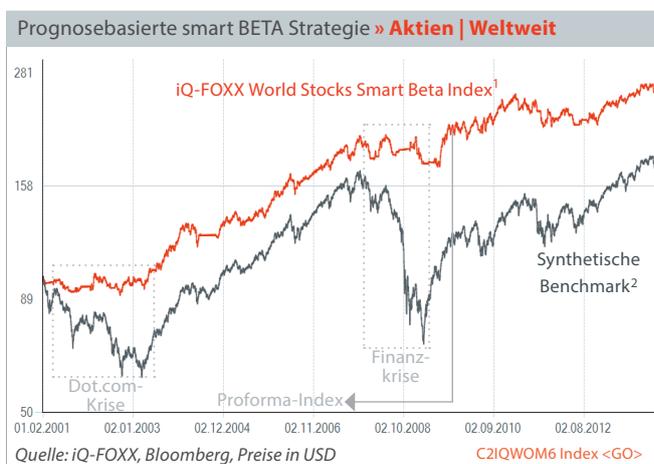
**Anlageuniversum** » USA-, Europa-, Asien Pazifik-Aktien oder Cash

**Gewichtung** » von 100 % Aktien bis 100 % Cash

13-Jahreskennziffern (01.02.2001 - 5.2.2014)	iQ-FOXX Index	Synthetische Benchmark
Kumulierte Rendite %	154,2	73,52
Rendite p.a. %	7,43	4,32
Volatilität p.a. %	9,64	16,44
Max. Draw-Down in %	15,41	58,49

Jahreskennziffern	2001	2002	2003	2004	2005	2006	2007	2008	2009	2010	2011	2012	2013
Performance p.a.	-5,57	1,15	29,54	8,68	8,88	18,46	12,08	1,1	7,24	13,71	-7,71	3,95	14,39
Volatilität p.a.	6,0	9,29	9,79	8,62	7,81	8,72	9,7	9,38	12,87	11,8	12,43	8,57	7,91

Live Indexberechnung, Quelle: iQ-FOXX



### Cross Asset Weltweit

**Strategie** » smart BETA | Cross Asset | Weltweit

**Anlageuniversum** » USA-, Europa-, Asien Pazifik-Aktien, REITs weltweit, USD- und EUR- Investment-Grades und Cash

**Gewichtung** » 0% -50% Aktien, 0% -35% Investment-Grades, 0% -17% REITs oder 0% - 100% Cash

13-Jahreskennziffern (08.01.2001 - 05.02.2014)	iQ-FOXX Index	Synthetische Benchmark
Kumulierte Rendite %	185,51	98,56
Rendite p.a. %	8,34	5,38
Volatilität p.a. %	5,6	9,6
Max. Draw-Down in %	9,88	42,45

Jahreskennziffern	2001	2002	2003	2004	2005	2006	2007	2008	2009	2010	2011	2012	2013
Performance p.a.	0,81	3,29	23,89	8,74	13,5	17,57	13,22	2,9	6,48	11,7	-4,29	7,83	7,41
Volatilität p.a.	3,61	5,13	6,33	5,51	4,85	5,55	6,31	5,64	7,51	6,58	5,54	4,34	4,7

Live Indexberechnung, Quelle: iQ-FOXX

