

Emerging Markets Bonds Smart Beta

Benchmark Index: Emerging Markets Bonds

Unsere Philosophie: Ein intelligentes Index-Konzept

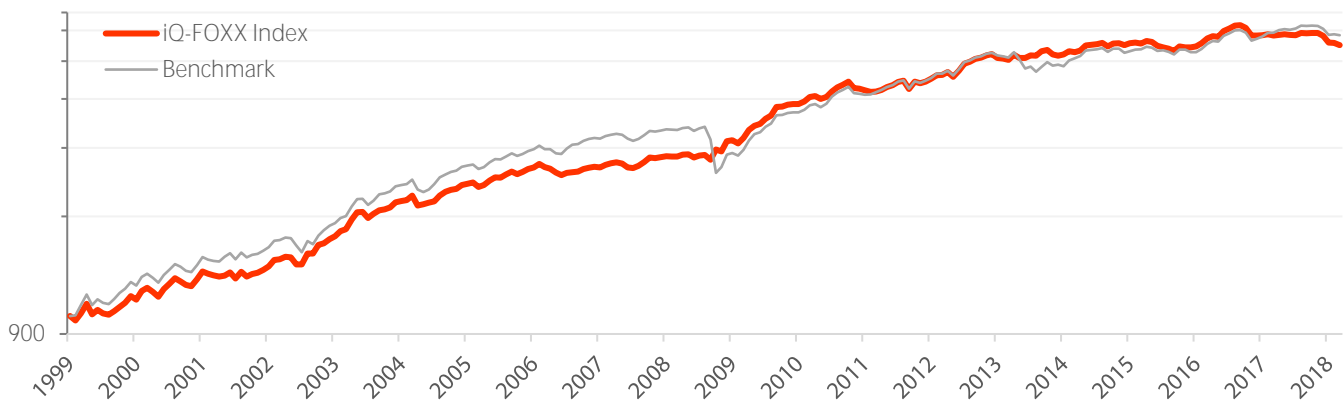
iQ-FOXX ist ein international tätiger Indexanbieter. Die Produktpalette umfasst über 350 regelbasierte Indizes, die von Fondsgesellschaften und Vermögensverwaltern für Fonds, strukturierte und Multi-Asset Produkte sowie Managed Accounts genutzt werden. Der Gründer und CEO Dr. Miro Mitev entwickelt die 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.

Übersicht 01/1999 - 03/2018

in %	iQ-FOXX	Index
Gesamtrendite	395,3	424,4
Rendite p.a.	8,7	9,0
Volatilität p.a.	7,5	9,3
Sharpe Ratio	1,2	1,0

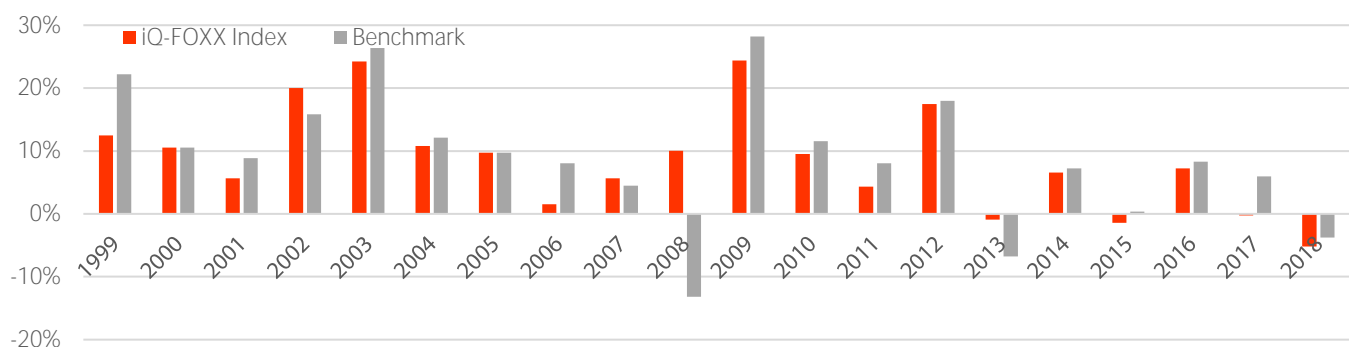
Ziel: Steigerung des Risiko-/Ertragsverhältnis

Die regelbasierte iQ-FOXX Methodik verwendet makroökonomische, fundamentale und technische Variablen. So können Verlustphasen deutlich reduziert und in steigenden Märkten das Ertragspotenzial bestmöglich ausgeschöpft werden.



von bis	Netto Performance		Volatilität		Sharpe Ratio	
	iQ-FOXX	Benchmark	iQ-FOXX	Benchmark	iQ-FOXX	Benchmark
01/1999 03/2018						
1 Jahr	-5,4%	-1,5%	4,2%	4,5%	-1,28	-0,34
3 Jahre	-0,3% p.a.	2,8% p.a.	5,6% p.a.	5,8% p.a.	-0,05	0,48
5 Jahre	1,8% p.a.	2,7% p.a.	5,5% p.a.	6,8% p.a.	0,32	0,39
7 Jahre	4,0% p.a.	4,9% p.a.	6,1% p.a.	6,9% p.a.	0,66	0,71
10 Jahre	6,8% p.a.	5,7% p.a.	6,8% p.a.	9,7% p.a.	1,00	0,59
15 Jahre	7,5% p.a.	7,4% p.a.	6,7% p.a.	8,8% p.a.	1,13	0,83
seit Start	8,7% p.a.	9,0% p.a.	7,5% p.a.	9,3% p.a.	1,16	0,97
Jahr 2008	10,0%	-13,2%	8,8%	20,2%	1,13	-0,65

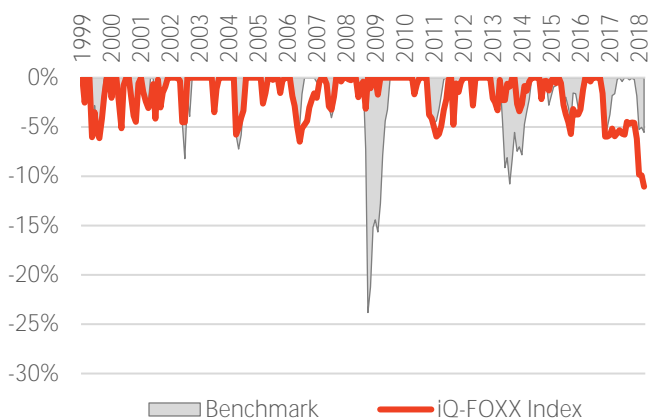
Jährliche Performance



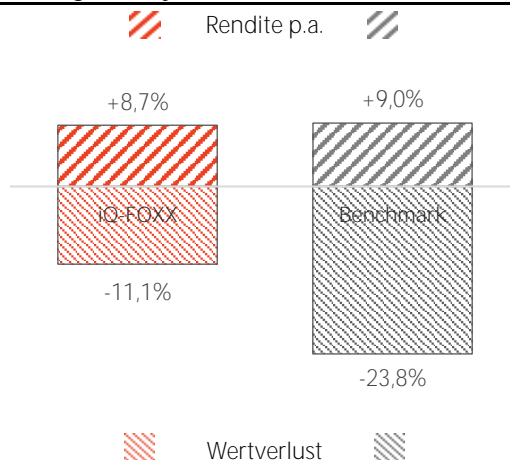
Emerging Markets Bonds Smart Beta

Benchmark | Emerging Markets Bonds

Wertverlust



Risiko/Ertrags-Analyse



Kennzahlen

	iQ-FOXX	Benchmark
Gesamtrendite	395,3%	424,4%
Rendite p.a.	8,7%	9,0%
Sharpe Ratio	1,16	0,97
Bestes Monat	6,7%	7,7%
Schlechtestes Monat	-6,0%	-17,8%
Volatilität p.a.	7,5%	9,3%
Downside Volatilität p.a.	4,7%	8,5%
max. Wertverlust	-11,1%	-23,8%
Längste Erholungsphase	18 Monate	12 Monate

Korrelation des iQ-FOXX Index zu:

Emerging Markets Bonds	0,73
Anleihen weltweit	0,42
Aktien weltweit	0,26
Rohstoffe	0,07

Beta des iQ-FOXX Index:

zum Benchmark Index	0,59
---------------------	------

Monatliche Performance

in % | iQ-FOXX | Benchmark

Jahr	Jän	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	Gesamt													
2018	-3,9	-3,5	-0,1	0,2	-1,3	-0,5							-5,2	-3,8												
2017	0,2	1,3	0,7	2,0	-0,8	0,2	0,3	1,5	0,3	0,7	-0,4	-0,4	-0,1	0,7	1,4	1,7	-0,2	-0,2	0,2	0,2	-0,1	-0,1	-1,7	-1,7	-0,2	6,0
2016	0,5	-0,1	2,0	1,9	2,7	3,1	1,3	1,7	-0,4	-0,4	3,6	3,6	1,4	1,4	1,8	1,8	0,2	0,2	-1,6	-1,6	-4,4	-4,6	0,0	1,2	7,2	8,3
2015	1,0	1,0	0,4	0,9	-0,6	0,1	1,5	1,5	-0,6	-0,6	-2,2	-1,8	-0,9	0,4	-0,8	-1,0	-1,3	-1,4	2,7	2,9	-0,6	-0,1	0,0	-1,5	-1,4	0,4
2014	0,7	-0,9	1,9	3,4	-0,5	1,3	0,9	1,3	3,1	3,3	0,4	0,4	0,4	0,4	0,8	0,8	-2,2	-2,2	1,9	1,9	0,0	0,0	-1,0	-2,5	6,6	7,2
2013	-2,1	-1,6	-0,4	-0,4	-0,8	-0,8	3,2	3,2	-2,0	-4,1	0,0	-5,2	1,7	1,1	-0,3	-2,9	2,8	2,9	0,7	2,9	-2,7	-2,0	-0,8	0,5	-0,9	-6,8
2012	1,6	1,6	2,2	2,6	0,1	0,1	1,8	1,8	-2,8	-2,8	3,8	3,8	4,2	4,2	1,1	1,1	1,7	1,7	0,8	0,8	1,4	1,4	0,7	0,7	17,5	18,0
2011	-0,9	-0,5	-1,1	0,2	0,3	1,3	0,9	1,4	1,7	1,7	1,1	1,1	2,1	2,1	0,7	0,7	-4,8	-4,8	4,4	4,4	-0,9	-0,9	1,0	1,3	4,3	8,0
2010	0,1	0,1	1,5	1,5	2,6	2,6	0,7	0,7	-1,7	-1,7	1,1	2,0	3,2	4,2	2,5	2,5	1,6	1,6	1,9	1,9	-3,8	-3,8	-0,4	-0,4	9,5	11,6
2009	0,5	0,9	-1,7	-1,4	3,2	3,4	4,8	5,6	2,4	3,8	1,2	1,2	3,2	3,2	1,9	1,9	5,2	5,2	0,2	0,2	1,1	1,1	0,4	0,4	24,4	28,2
2008	0,7	0,7	-0,2	-0,2	-0,1	-0,1	1,1	1,1	0,3	0,3	-2,0	-2,0	1,1	1,5	0,4	1,0	-2,7	-7,3	6,2	-17,8	-1,1	3,4	6,2	7,7	10,0	-13,0
2007	-0,4	-0,4	1,6	1,6	0,8	0,8	0,6	0,6	-0,6	-0,6	-2,3	-2,3	-0,4	-1,2	1,4	1,1	2,3	2,3	2,6	2,6	-0,4	-0,4	0,6	0,6	5,7	4,5
2006	1,0	1,0	2,1	2,1	-1,9	-1,9	-1,0	-0,2	-2,2	-2,3	-1,6	-0,5	1,4	3,2	0,4	2,4	0,4	0,3	1,4	1,9	0,8	1,1	0,6	0,6	1,5	8,0
2005	0,7	0,7	0,7	0,7	-2,6	-2,6	1,1	1,1	2,8	2,8	1,9	1,9	-0,2	-0,2	1,8	1,8	1,9	1,9	-1,6	-1,6	1,3	1,3	1,7	1,7	9,7	9,7

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.