



MULTI-FAKTOR WELTPORTFOLIO

ETFs • prognosefrei • wissenschaftlich

PROGNOSEFREIHEIT UND WISSENSCHAFT

Prognosefreies, nicht-spekulatives Investieren mit kostengünstigen Indexfonds ist aufgeklärtes Buy-and-Hold (kein trading-motiviertes, kein spekulatives "Rein/Raus") und basiert auf einem Kanon etablierter wissenschaftlicher Erkenntnisse, für die mehrere Wirtschaftsnobelpreise vergeben wurden. Das MULTI-FAKTOR WELTPORTFOLIO investiert ausschließlich in kostengünstige Indexaktien.

FAKTOR-INVESTING (Smart Beta Investing)

Faktorprämien sind quantifizierbare, objektive Merkmale (Risiko-Rendite-Treiber) von Wertpapieren, die statistisch besonders große Erklärungskraft für historische und künftige Renditen und Risiken von Asset-Klassen besitzen. Die wichtigsten Faktorprämien bei Aktien:

- **Small-Size-Prämie:** Der Small-Size-Effekt besagt, dass kleine Aktiengesellschaften statistisch höhere
- **Value-Prämie:** Value-Aktien sind preisgünstige Aktien, die aus einem unternehmensspezifischen Grund unpopulär geworden sind oder einer altmodischen, schwach wachsenden Branche angehören.
- **Momentum-Prämie:** Momentum ist die Tendenz von Aktien ihre Rendite relativ zum Gesamtmarkt während der vergangenen rund 12 Monate noch einmal einige Monate fortzusetzen.
- **Quality-Prämie:** Quality-Aktien sind solche, die bei einer Reihe betriebswirtschaftlicher Kennzahlen besonders vorteilhafte Werte besitzen.
- **Political Risk-Prämie:** Das gegenüber Industrieländern erhöhte Investmentrisiko von Emerging-Markets wird durch eine höhere Renditeerwartung kompensiert.

HISTORISCHE FAKTOR-PRÄMIEN (nach Inflation)

- Small-Size: +3,3 % p.a. vs. Standard (1975 bis 2020)
- Value: +0,4 % p.a. vs. Standard (1975 bis 2020)
- Momentum: +4,3 % p.a. vs. Standard (1995 bis 2020)
- Quality: +3,4 % p.a. vs. Standard (1995 bis 2020)
- Political-Risk: +0,6 % p.a. vs. Standard (1995 bis 2020)

Quelle: <https://gerd-kommer.de/factor-investing-die-basics/>

FONDSDATEN

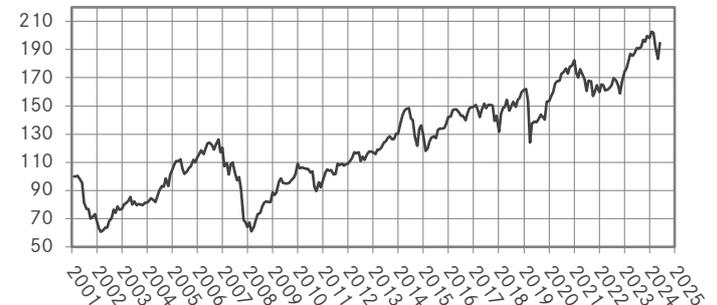
Fondstypus: Passiv gemanagter Multi-Faktor ETF-Dachfonds
 ISIN: AT0000689294
 Währung/Start: EUR / 01.02.2002
 Management: Privatconsult Vermögensverwaltung GesmbH
 KAG: LB Invest KAG
 Mindestanlage: € 750,- / Sparplan € 50,- p.m.

WHITE.HEAD Consulting GmbH
 Promoter des MULTI-FAKTOR WELTPORTFOLIO
 A-8200 Gleisdorf, Greithbachweg 10,
 Tel: 0650/9033 888, office@indexweltportfolio.at
 www.indexweltportfolio.at

WERTENTWICKLUNG (Aktueller Kurs 175,85)

5 Jahre 7,02 % p.a. 1 Jahr 3,54 %
 3 Jahre 15,22 % p.a. 2025 (year-to-date) -1,83 %

(Quelle: eigene Berechnungen)



ETF-GEWICHTUNG (Näherungswerte)

Aktien global (mit Faktor) 68,00 %
 Xtrackers MSCI World World Quality Factor 17,00 %
 Xtrackers MSCI World World Value Factor 17,00 %
 Xtrackers MSCI World World Momentum Factor 17,00 %
 iShares MSCI World World Small Cap 17,00 %

Aktien Europa (mit Faktor) 9,00 %
 iShares Edge MSCI Europe Quality Factor 2,25 %
 iShares Edge MSCI Europe Value Factor 2,25 %
 iShares Edge MSCI Europe Momentum Factor 2,25 %
 iShares STOXX Europe Small 200 2,25 %

Schwellenländer Aktien und Anleihen 18,25%
 iShares Core MSCI Emerging Markets IMI UCITS ETF ... 18,25%
Immobilien Aktien global 4,75 %
 Amundi Index FTSE EPRA NAREIT Global 4,75 %

AUSGEWOGENE REGIONEN-GEWICHTUNG

(Näherungswerte)

USA/Nordamerika 49 %
 Westeuropa 22 %
 Japan/Pazifik 9 %
 Asien / Schwellenländer 20 %

TER der ETFs ca. 0,25 %

HINWEIS: Diese Marketingmitteilung dient ausschließlich Informationszwecken und stellt kein Angebot oder Aufforderung zum Kauf/Verkauf von Fondsanteilen dar. Das Factsheet berücksichtigt nicht die persönlichen Verhältnisse des Anlegers und ersetzt daher keine Beratung. WHITE.HEAD übernimmt keine Haftung für Ansprüche, die auf fehlerhaften und/oder lückenhaften Informationen dieses Factsheets beruhen. Vergangenheitswerte erlauben keine Rückschlüsse auf die künftige Entwicklung. Mit der Investition in dieses Produkt sind nicht nur Chancen, sondern auch Risiken verbunden. Aktuelle Fondsunterlagen sind über die WHITE.HEAD Consulting GmbH sowie der Website der LLB Österreich erhältlich. Kursquelle: LLB. Quelle Renditen „Faktor-Prämien“: Kommer Gerd, Souverän investieren mit Indexfonds und ETFs, campus Verlag