

## Intelligente Optionsprämienstrategie mit attraktivem Risiko-Ertrags-Profil

*Deka Investment und IQAM Invest legen ersten gemeinsamen Fonds mit Optionsprämienstrategie auf*

Nach einem erfolgreichen ersten gemeinsamen Jahr bauen Deka Investment und IQAM Invest ihre Kompetenz im Bereich quantitativer Produktlösungen weiter aus. Mit der Auflage des IQAM Optionsprämienstrategie Protect (AT0000A2W9Q3, AT0000A2W9P5) bieten IQAM Invest und Deka Investment eine Anlagemöglichkeit, welche auf die systematische Vereinnahmung von Optionsprämien bei einem attraktiven Risiko-Ertrags-Profil setzt. Der Fondsstart erfolgt am 21.04.2022. Deka Investment wird dabei das Management des Fonds übernehmen und IQAM Invest als Kapitalverwaltungsgesellschaft agieren.

### Kombination aus Short-Put- und Long-Put-Optionen

Beim IQAM Optionsprämienstrategie Protect bilden nachhaltige Anleihen guter Bonität wie beispielsweise (Quasi-) Staatsanleihen oder Pfandbriefe aus der Eurozone (alle mindestens Investmentgrade) das Basisportfolio. Durch den systematischen Verkauf von Put-Optionen auf Aktienindizes soll ein kontinuierlicher Zusatzertrag erwirtschaftet werden – ähnlich wie bei einem Portfolio aus Aktienanleihen. Als Schutz vor großen Markteinbrüchen werden zusätzlich aber auch Put-Optionen mit einem geringeren Ausübungspreis gekauft, die Verluste im Ernstfall eingrenzen sollen.

### Interessante Strategiekomponenten für Investoren

„Die Verwendung von nachhaltigen europäischen Aktienindizes (als Basiswerte) erhöht die Liquidität und reduziert die Handelskosten“, freut sich Dr. Thomas Steinberger, CIO und Geschäftsführer von IQAM Invest über die erste gemeinsame Auflage des Quant-Produkts. Die Auswahl und Gewichtung des Basiswerts bestimmen sich aus der Attraktivität und dem Diversifikationspotenzial in der Portfoliokonstruktion. Anleihen hoher Liquidität sowie Bonität als Basisinvestition, kurze Restlaufzeiten, möglichst hohe Marktliquidität auch in Krisenphasen und ein möglichst geringer Risikobeitrag zum Gesamtportfolio runden die Strategie ab. Die Laufzeit der Optionen liegt im mittleren unterjährigen Band – sie müssen aber nicht bis zum Laufzeitende gehalten werden, um Timing-Risiken der Wiederanlage zu reduzieren. Die Wahl des Strikes (Ausübungspreis der Option) ergibt sich aus der festgelegten Zielrendite und aus der Höhe der impliziten Volatilitäten. Diese Vorgehensweise ermöglicht eine zielgenaue Steuerung der erwarteten Rendite.

### Ausbau der Kompetenz bei quantitativen Produktlösungen

IQAM Invest und das Quant-Team der Deka Investment bauen seit Anfang 2021 gemeinsam ihre Kompetenz im Bereich quantitativer Produktlösungen aus. Für Investoren bedeutet dies einen noch früheren Zugang zu wissenschaftlichen Erkenntnissen und Forschungsergebnissen mehrerer Universitäten. Der Fokus der Zusammenarbeit liegt im Forschungsbereich, der durch die Bündelung von Ressourcen und Kompetenzen auf höchstes europäisches Niveau gehoben werden kann.

Im Bild: Dr. Thomas Steinberger, CIO und Geschäftsführer von IQAM Invest (IQAM Invest/Abdruck honorarfrei!)

#### Rückfragehinweis:

IQAM Invest GmbH  
Mag. Veronika Flandera, CPM  
Tel +43 505 8686-868  
veronika.flandera@iqam.com  
[www.iqam.com](http://www.iqam.com)

#### Wichtige Informationen zur Marketingmitteilung

**Der Fonds kann überwiegend in liquide Vermögenswerte investieren, die keine Wertpapiere oder Geldmarktinstrumente im Sinne des Investmentfondsgesetzes sind, nämlich in Sichteinlagen und kündbare Einlagen sowie Derivate.** Dieses Dokument stellt kein Angebot und keine Empfehlung zum Kauf oder Verkauf von Finanzprodukten dar und enthält auch keine Aufforderung, ein solches Angebot zu stellen. Der Wert eines Finanzinstruments ist Schwankungen unterworfen und kann sowohl steigen als auch fallen. Die Angaben basieren auf den zum Erstellungszeitpunkt aktuell verfügbaren Daten. Die Fonds werden nach dem österreichischen Investmentfondsgesetz verwaltet und in Österreich vertrieben. Die Prospekte sowie allfällige Änderungen wurden gem. § 136 InvFG 2011 veröffentlicht. Die geltende Fassung der Prospekte sowie der Wesentlichen Anlegerinformationen (= Kundeninformationsdokument, KID) liegen in deutscher Sprache bei der IQAM Invest GmbH und der Depotbank des jeweiligen Fonds auf und sind auf [www.iqam.com](http://www.iqam.com) verfügbar. Bei bestehender Zulassung zum öffentlichen Vertrieb in Deutschland sind diese Dokumente auch bei der Zahl- und Informationsstelle, der State Street Bank International GmbH, München, erhältlich. Eine Zusammenfassung der Anlegerrechte in deutscher Sprache sowie Informationen zu im Falle etwaiger Rechtsstreitigkeiten zugänglichen Instrumenten der kollektiven Rechtsdurchsetzung auf nationaler und Unionsebene ist unter [www.iqam.com/de/downloads](http://www.iqam.com/de/downloads) verfügbar. Für Richtigkeit und Vollständigkeit der Inhalte kann trotz sorgfältiger Recherche und Erfassung sowie verlässlicher Quellen keine Haftung übernommen werden.

#### IQAM Invest GmbH

**Standort Salzburg**  
Franz-Josef-Straße 22  
5020 Salzburg  
T +43 505 8686-0  
F +43 505 8686-869

**Standort Wien**  
Wollzeile 36-38  
1010 Wien  
T +43 505 8686-0  
F +43 505 8686-869

**Standort Frankfurt am Main**  
Mainzer Landstraße 16  
60325 Frankfurt am Main  
T +49 69 2714 7385-0

[office@iqam.com](mailto:office@iqam.com)  
[www.iqam.com](http://www.iqam.com)

Sitz Salzburg  
FN 54453 d  
Landesgericht Salzburg  
IBAN AT47 1953 0001 0019 4105  
BIC SPAEAT2S  
UID ATU38580200