THEAM QUANT Equity Europe Dynamic Factor Defensive I Capitalisation / LU1685632132 / A2JLZN / BNP PARIBAS AM Eur.

Aktuell 19.11.2026 [1]	Region	Branche	Ausschüttungsart	Typ
149,79 EUR	Europa	AI Hedgefonds Single Strategy	thesaurierend	Alternative Investm.



Performanceergebnisse der Vergangenheit lassen keine Rückschlüsse auf die künftige Entwicklung zu.

Risikokennzahlen

SRI 1 2 **3** 4 5 6 7

Jahresperformance

2025	+11,88%
2024	+9,97%
2023	+14,94%
2022	-14,06%
2021	+22,47%

Stammdaten

Fondart	Einzelfond
Kategorie	Alternative Investments
Fondsunterkategorie	AI Hedgefonds Single Strategy
Ursprungsland	Luxemburg
Tranchenvolumen	(19.11.2026) EUR 75,01 Mio.
Gesamt-Fondsvolumen	(19.11.2026) EUR 98,65 Mio.
Auflagedatum	25.01.2018
KESt-Meldefonds	Ja
Beginn des Geschäftsjahres	01.01.
Nachhaltigkeitsfondsart	-
Fondsmanager	Solène DEHARBONNIER
	RICCI Fabrice
Thema	-

Konditionen

Ausgabeaufschlag	0,00%
Managementgebühr	0,54%
Depotgebühr	-
Tilgungsgebühr	0,00%
Sonstige lfd. Kosten (31.07.2026)	0,80%
Transaktionskosten	0,46%

Sonstige Kennzahlen

Mindestveranlagung	EUR 100.000,00
Sparplan	Nein
UCITS / OGAW	Ja
Gewinnbeteiligung	0,00%
Umschichtgebühr	1,50%

Fondsgesellschaft

BNP PARIBAS AM Eur.
1 BOULEVARD HAUSSMANN, 75009, Paris
Frankreich
https://www.bnpparibas-am.com

Performance	1M	6M	YTD	1J	2J	3J	5J	seit Beginn
Performance	+2,32%	+5,17%	+14,82%	+20,17%	+30,25%	+47,11%	+40,95%	+49,10%
Performance p.a.	-	-	-	+20,17%	+14,13%	+13,73%	+7,10%	+4,80%
Performance p.a. nach max. AGA	-	-	-	+20,17%	+14,13%	+13,73%	+7,11%	+4,79%
Sharpe Ratio	3,14	1,00	1,44	1,83	1,20	1,23	0,45	0,20
Volatilität	8,96%	7,71%	9,79%	9,49%	9,45%	8,89%	9,48%	9,78%
Schlechtester Monat	-	-2,53%	-3,98%	-3,98%	-3,98%	-3,98%	-5,08%	-10,28%
Bester Monat	-	+3,35%	+5,54%	+5,54%	+5,54%	+5,54%	+5,54%	+6,99%
Maximaler Verlust	-2,54%	-4,68%	-5,62%	-5,62%	-9,48%	-9,48%	-18,03%	-24,02%

Vertriebszulassung

Österreich, Deutschland, Schweiz, Luxemburg;

1. Wichtiger Hinweis zum Aktualisierungsstand: Das angegebene Datum bezieht sich ausschließlich auf die Berechnung des NAV.

RISIKOHINWEISE: Die Informationen auf dieser Seite dienen ausschließlich zu Informationszwecken und sollten weder als Verkaufsangebot noch als Aufforderung zum Kauf des Wertpapieres oder einer Empfehlung zugunsten des Wertpapieres verstanden werden. Die baha GmbH und die BAWAG P.S.K. Bank für Arbeit und Wirtschaft und Österreichische Postsparkasse Aktiengesellschaft übernehmen trotz sorgfältigster Recherche keinerlei Haftung für die Richtigkeit der angegebenen Daten.
Factsheet erstellt von: www.baha.com am 22.11.2026 09:47

THEAM QUANT Equity Europe Dynamic Factor Defensive I Capitalisation / LU1685632132 / A2JLZN / BNP PARIBAS AM Eur.

Investmentstrategie

Das Ziel des Modells, das für den Aufbau des optimalen Portfolios verwendet wird, basiert insbesondere auf einem Faktorauswahlansatz. Das Ziel eines solchen Faktoransatzes ist der Aufbau eines Portfolios, um eine Überrendite gegenüber traditionellen Marktkapitalisierungsreferenzindizes zu erzielen, (i) indem es in diversifizierten Wertentwicklungsfaktoren engagiert ist und (ii) einen Allokationsmechanismus implementiert, der darauf abzielt, das relative Risiko zwischen diesen Wertentwicklungsfaktoren gegenüber ihrem Referenzmarkt zu kontrollieren. Das zum Aufbau eines solchen optimalen Portfolios verwendete Modell besteht insbesondere aus folgenden Schritten: (a) Festlegung des anfänglichen Universums (das "Referenzportfolio"), das sich aus einem breiten und repräsentativen Korb europäischer Aktien zusammensetzt, (b) Festlegung des optimalen Portfolios über einen Optimierungsalgorithmus mit dem Ziel, Aktien durch die Verwendung mehrerer fundamentaler Indikatoren auszuwählen, um zu bestimmen, auf welche Anlagestile sich die Strategie konzentrieren soll. Die Auswahl auf der Grundlage von Anlagestilen besteht darin, Unternehmen mit dem besser eingestuften Merkmal in Bezug auf einen bestimmten Faktor auszuwählen: z. B. attraktive Bewertung zum Wert, bewährtes Geschäftsmodell für Qualität, positiver Trend für Dynamik und geringes Risikoprofil, d. h. stetiges Tempo für niedrige Volatilität. Die Optimierung erfolgt insbesondere gemäß den Haupteinschränkungen wie branchenspezifische Diversifizierung, Liquidität und Wertentwicklung in Korrelation mit der des europäischen...

Fondsspezifische Informationen

Im Rahmen der Anlagestrategie kann in wesentlichem Umfang in Derivate investiert werden. Die Fondsbestimmungen des THEAM QUANT Equity Europe Dynamic Factor Defensive I Capitalisation wurden durch die FMA bewilligt. Der THEAM QUANT Equity Europe Dynamic Factor Defensive I Capitalisation kann mehr als 35 % des Fondsvermögens in Wertpapiere/Geldmarktinstrumente folgender Emittenten investieren: by an EU Member State or its local authorities, by another OECD Member State, by certain non-OECD Member State (currently Brazil, Indonesia, Russia and South Africa) or by public international organisations in which one or more EU Member States are members..

Investmentziel

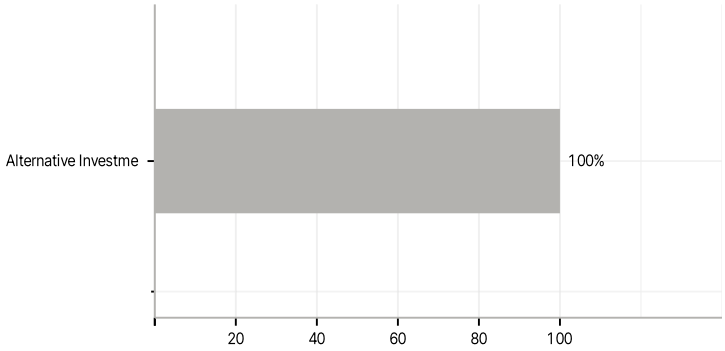
Das Ziel des Teilfonds ist die Erwirtschaftung von Kapitalzuwachs. Dies geschieht (i) durch ein Engagement in einem Korb aus europäischen Aktien unter Berücksichtigung nicht finanzbezogener Kriterien und (ii) durch die Umsetzung einer systematischen Optionsstrategie, deren Ziel die Verminderung des Risikos ist, indem die Volatilität des Teilfonds auf ein Minimum reduziert wird. Um sein Anlageziel zu erreichen, setzt der Teilfonds eine quantitative Anlagestrategie (die "Strategie") um, die sich auf zwei Säulen der Wertentwicklung stützt: (a) ein Long-Engagement in einem Korb europäischer Aktien auf der Grundlage eines Faktorauswahlansatzes (das "optimale Portfolio"), der sich auf ein systematisches und quantitatives Anlageverfahren stützt, und (b) eine ergänzende systematische Optionsstrategie auf einen oder mehrere der wichtigsten europäischen Aktienindizes, die das Risiko-Rendite-Verhältnis im Vergleich zu einer direkten Anlage im optimalen Portfolio verbessern soll, indem Long-Positionen in Put-Optionen auf diese Indizes eingegangen werden in Kombination mit einem Take-Profit-Mechanismus auf diese Put-Optionen, wobei die Finanzierung, soweit möglich, durch Eingehen von Short-Positionen auf Call-Optionen auf dieselben Indizes erfolgt. Die Put-Optionen-Strategie ist vor allem in ausgeprägten Baissemärkten angemessen, da sie es dem Teilfonds ermöglicht, die Auswirkungen fallender europäischer Aktienmärkte und somit seine Volatilität zu begrenzen. Die Call-Optionen-Strategie ist vor allem in stabilen oder ziemlich richtungslosen Märkten sinnvoll. Eine zusätzliche dynamische...

RISIKOHINWEISE: Die Informationen auf dieser Seite dienen ausschließlich zu Informationszwecken und sollten weder als Verkaufsangebot noch als Aufforderung zum Kauf des Wertpapieres oder einer Empfehlung zugunsten des Wertpapieres verstanden werden. Die baha GmbH und die BAWAG P.S.K. Bank für Arbeit und Wirtschaft und Österreichische Postsparkasse Aktiengesellschaft übernehmen trotz sorgfältigster Recherche keinerlei Haftung für die Richtigkeit der angegebenen Daten.
Factsheet erstellt von: www.baha.com am 22.11.2026 09:47

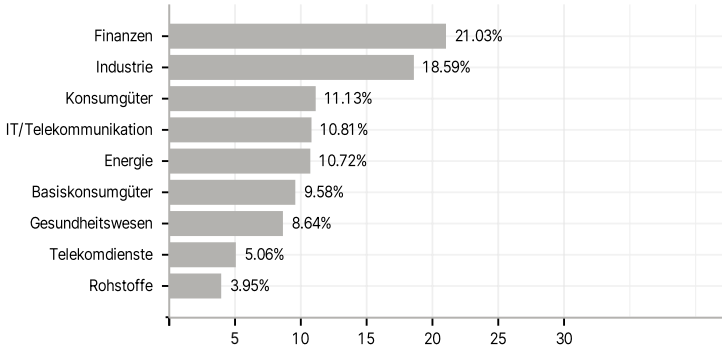
THEAM QUANT Equity Europe Dynamic Factor Defensive I Capitalisation / LU1685632132 / A2JLZN / BNP PARIBAS AM Eur.

Veranlagungsstruktur

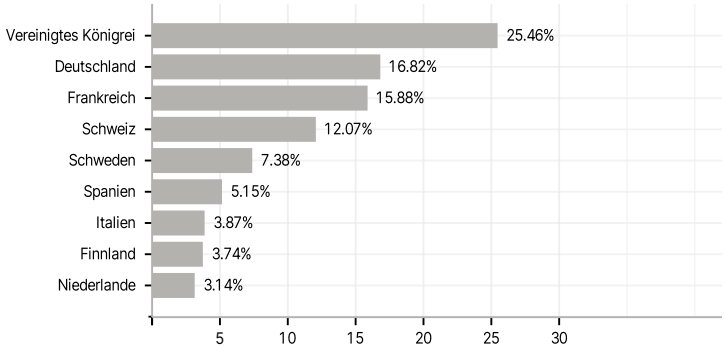
Anlagearten



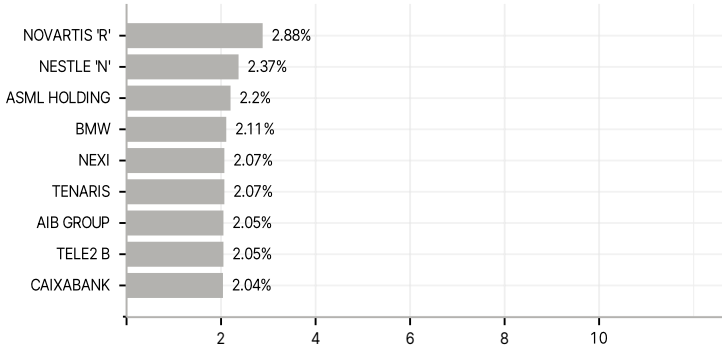
Branchen



Länder



Größte Positionen



RISIKOHINWEISE: Die Informationen auf dieser Seite dienen ausschließlich zu Informationszwecken und sollten weder als Verkaufsangebot noch als Aufforderung zum Kauf des Wertpapieres oder einer Empfehlung zugunsten des Wertpapieres verstanden werden. Die baha GmbH und die BAWAG P.S.K. Bank für Arbeit und Wirtschaft und Österreichische Postsparkasse Aktiengesellschaft übernehmen trotz sorgfältigster Recherche keinerlei Haftung für die Richtigkeit der angegebenen Daten.
Factsheet erstellt von: www.baha.com am 22.11.2026 09:47