JPM-Diversified Risk Fd.I(acc)USD (LU0875418518)

KAG: JPMorgan AM (EU) | ISIN: LU0875418518 | Rücknahmepreis: 137,68 USD | Stand: 27.03.2024

Auflagedatum	23.04.21
Ausgabeaufschlag	-
Konditionsdetails auf www.easybank.at	
Fondvolumen	446.35 Mio.
Ertragstyp	thesaurierend
Letzte Ausschüttung	keine
Anlageregion	weltweit
Fondstyp	AI Hedgefonds Single Strategy
Fondsmanager	Yazann Romahi, Wei Victor...

Kapitalanlagegesellschaft

JPMorgan AM (EU)
PO Box 275
2012 Luxembourg
Luxemburg
https://www.jpmorganassetmanagement.de



Wertentwicklung*	1J	3J p.a.	5J p.a.
Performance vor AGA	+18,28%	+11,54%	-
Performance nach max. AGA	+18,28%	+11,54%	-

Kennzahlen*	1J	3J	5J
Sharpe Ratio	2,84	-	-
Volatilität	+5,07%	-	-

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

Fondsstrategie

Erzielung eines langfristigen Kapitalwachstums durch die Anlage in mehreren Anlageklassen weltweit unter Verwendung eines risikogewichteten Ansatzes für die Vermögensallokation, wobei gegebenenfalls Derivate eingesetzt werden.
Anlageansatz: Ein systematischer Ansatz, der Long/Short-Positionen in einem diversifizierten Spektrum von Risikoaufschlägen über verschiedene Anlageklassen bietet. Das Portfolio strebt gleichgewichtete langfristige Risikoengagements in verschiedenen Risikoaufschlägen an, die sich auf vier Stile aufteilen: Qualität, Carry, Dynamik und Werthaltigkeit. Das Gesamtportfolio ist so aufgebaut, dass eine geringe Korrelation zu den traditionellen Märkten gewahrt wird. Wichtigste Anlagen: Die Mehrheit der Vermögenswerte wird entweder direkt oder über Derivate in Aktien, einschließlich Aktien kleinerer Unternehmen, wandelbare Wertpapiere, Schuldtitel und Währungen investiert. Der Teilfonds kann auch über Aktien, OGAW, OGA, ETFs oder Derivate auf Rohstoffindizes in Rohstoffen anlegen. Die Emittenten können an beliebigen Orten weltweit, einschließlich der Schwellenländer, ansässig sein. Der Teilfonds kann in Schuldtitel unterhalb von Investment Grade und in Schuldtitel ohne Rating investieren. Der Teilfonds kann Netto-Long- und Netto-Short-Positionen über ein Engagement mittels Derivaten in verschiedenen Sektoren, Märkten und Währungen eingehen. Er wird jedoch jederzeit insgesamt ein Netto- Long-Marktengagement wahren. Der Teilfonds kann bis zu 100% seiner Vermögenswerte in Einlagen bei Kreditinstituten, Geldmarktinstrumenten und Geldmarktfonds halten, entweder als Sicherheiten für Derivate oder bis passende Anlagemöglichkeiten gefunden werden. Der Teilfonds verteilt sein Vermögen über eine systematische Long- Short-Strategie, um ein Engagement in verschiedenen Risikoprämien aufzubauen. Die verschiedenen Risikoprämien können unter anderem ausgerichtet sein auf den Wert von Aktien (Long-Positionen in vergleichsweise günstigeren Aktien, Short-Positionen in vergleichsweise teureren Aktien), die Qualität von Aktien (Long-Positionen in Aktien von qualitativ hochwertigeren Unternehmen, basierend auf Kennzahlen wie der Rentabilität, Short-Positionen in Unternehmen von geringerer Qualität), das Carry von Devisen (Long-Positionen in Währungen mit höheren Renditen, Short-Positionen in Währungen mit niedrigeren Renditen) und die Kursdynamik bei Anleihen (Long-Positionen in Anleihen mit tendenziell steigenden Kursen, Short-Positionen in Anleihen mit negativer Kursentwicklung). Die Allokation in Risikoprämien kann je nach Marktchancen variieren. Die Engagements...

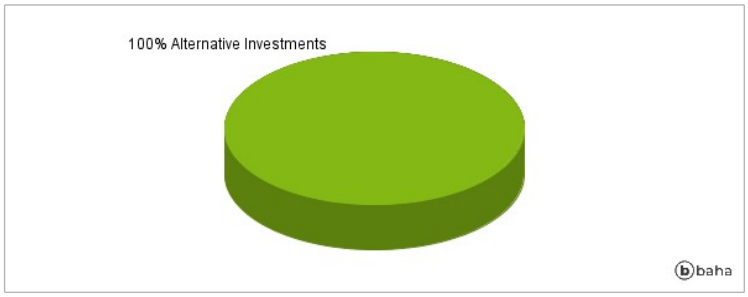
Kommentar:

Fondsspezifische Information

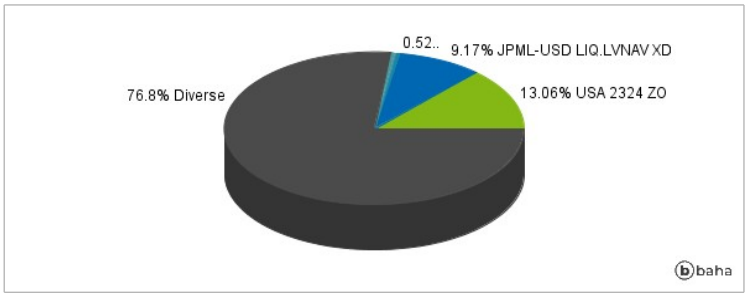
Im Rahmen der Anlagestrategie kann in wesentlichem Umfang in Derivate investiert werden. Die Fondsbestimmungen des JPM-Diversified Risk Fd.I(acc)USD wurden durch die FMA bewilligt. Der JPM-Diversified Risk Fd.I(acc)USD kann mehr als 35 % des Fondsvermögens in Wertpapiere/Geldmarktinstrumente folgender Emittenten investieren: the EU, the national, regional and local administrations of the Member States or their central banks, the European Central Bank, the European Investment Bank, the European Investment Fund, the European Stability Mechanism, the European Financial Stability Facility, a central authority or central bank of a member state of the OECD, Group of Twenty or Singapore, the International Monetary Fund, the International Bank for Reconstruction and Development, the Council of Europe Development Bank, the European Bank for Reconstruction and Development, the Bank for International Settlement.

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

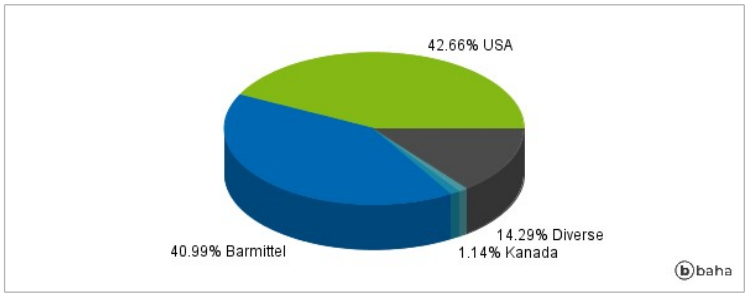
Anlagearten



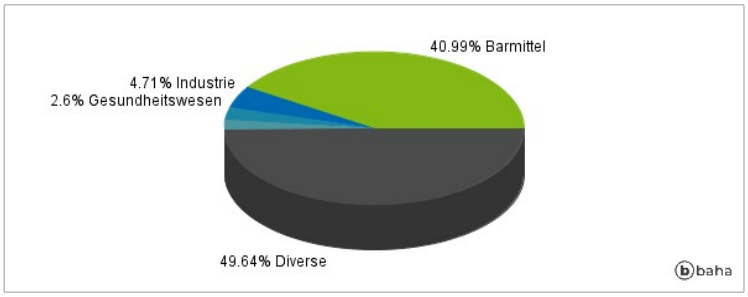
Größte Positionen



Länderverteilung



Branchenverteilung



Historische Daten: 03/2024

Erstellt: 29.03.2024 05:55

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