THEAM Quant Eq.Europe Factor D.I EUR (LU1685632306)

KAG: BNP PARIBAS AM (LU) | ISIN: LU1685632306 | Rücknahmepreis: 115,18 EUR | Stand: 07.05.2024

Auflagedatum	21.12.20
Ausgabeaufschlag	-
Konditionsdetails auf www.easybank.at	
Fondvolumen	83.22 Mio.
Ertragstyp	ausschüttend
Letzte Ausschüttung	keine
Anlageregion	Europa
Fondstyp	AI Hedgefonds Single Strategy
Fondsmanager	Solène DEHARBONNIER

Kapitalanlagegesellschaft

BNP PARIBAS AM (LU)
10
rue Edward Steichen 2540
Luxemburg
https://www.bnpparibas-am.com

Wertentwicklung*	1J	3J p.a.	5J p.a.
Performance vor AGA	+12,74%	+4,07%	-
Performance nach max. AGA	+12,74%	+4,07%	-

Kennzahlen*	1J	3J	5J
Sharpe Ratio	1,18	0,03	-
Volatilität	+7,64%	+9,60%	-

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

Fondsstrategie

Das Ziel des Teilfonds ist die Erwirtschaftung von Kapitalzuwachs. Dies geschieht (i) durch ein Engagement in einem Korb aus europäischen Aktien 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. Ein Long-Engagement in einem Korb europäischer Aktien über den BNP Paribas DEFI Equity Europe Long Net TR Index (der "Strategieindex").Der Strategieindex strebt an, Aktien anhand eines systematischen und quantitativen Anlageverfahrens auszuwählen. Darüber hinaus wendet er eine ergänzende systematische Optionsstrategie auf einen oder mehrere der wichtigsten europäischen Aktienindizes an, die das Risiko Rendite-Verhältnis im Vergleich zu einer direkten Anlage im Strategieindex verbessern soll, indem Long-Positionen auf Put-Optionen auf diese Indizes eingegangen werden, die, soweit möglich, durch Eingehen von Short-Positionen auf Call-Optionen auf dieselben Indizes finanziert werden sollen.
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. Der Strategieindex basiert auf einem systematischen, von BNP Paribas entwickelten Anlageverfahren und wird jeden Monat anhand eines spezifischen Algorithmus neu gewichtet, der darauf abzielt, (i) Aktien durch eine Kombination aus vier Performance-Faktoren auszuwählen: Wert, Qualität, Dynamik und niedrige Volatilität, (ii) von diesen Faktoren durch Diversifizierung der Anlage zu profitieren, und (iii) ein Beta nahe 1 und einen ex-ante Tracking Error unter 3,5 % zu erzielen, d. h. eine Performance, die mit der Performance des STOXX Europe 600 Net Return EUR Index (Bloomberg-Code: SXXR index) korreliert.

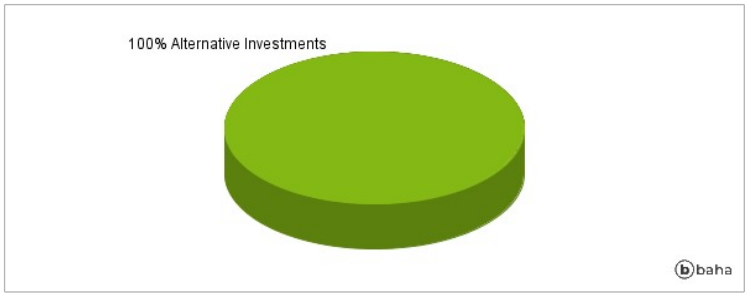
Kommentar:

Fondsspezifische Information

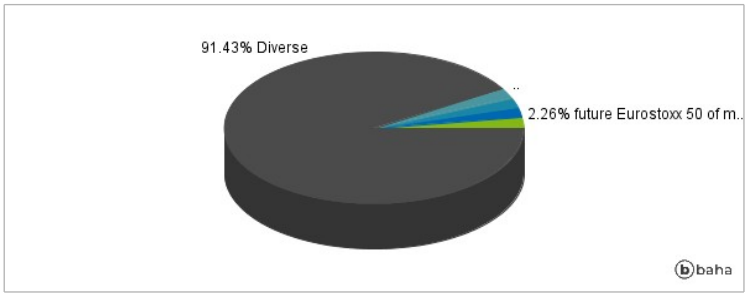
Im Rahmen der Anlagestrategie kann in wesentlichem Umfang in Derivate investiert werden. Aufgrund der Zusammensetzung des Fonds oder der verwendeten Managementtechniken weist der Fonds eine erhöhte Volatilität auf, d.h. die Anteilswerte sind auch innerhalb kurzer Zeiträume großen Schwankungen nach oben und nach unten ausgesetzt, wobei auch Kapitalverluste nicht ausgeschlossen werden können. Der THEAM Quant Eq.Europe Factor D.I EUR 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..

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

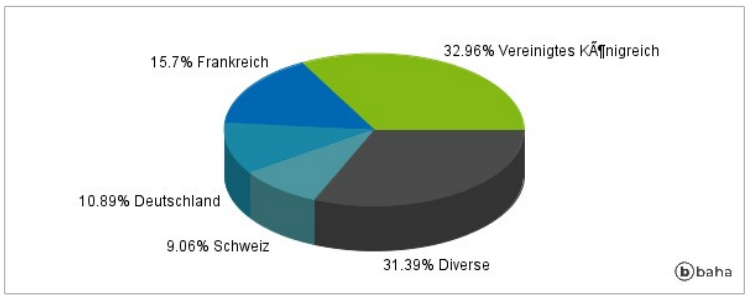
Anlagearten



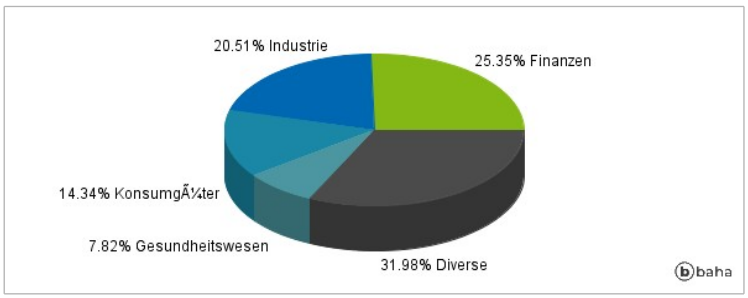
Größte Positionen



Länderverteilung



Branchenverteilung



Historische Daten: 05/2024

Erstellt: 11.05.2024 08:59

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