

THEAM Quant Eq.US DEFI C USD (LU1542719536)

KAG: BNP PARIBAS AM (LU)

ISIN: LU1542719536

Rücknahmepreis: 176,33 USD

Stand: 15.05.2024

Auflagedatum	15.12.17
Ausgabeaufschlag	3,00%
Konditionsdetails auf www.bawag.at	
Fondsvolumen	8.24 Mio.
Ertragstyp	thesaurierend
Letzte Ausschüttung	keine
Anlageregion	USA
Fondstyp	Branchenmix
Fondsmanager	Fabrice RICCI

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	+29,02%	+8,22%	+10,94%
Performance nach max. AGA	+25,27%	+7,15%	+10,29%

Kennzahlen*

	1J	3J	5J
Sharpe Ratio	2,24	0,27	0,34
Volatilität	+11,31%	+16,53%	+21,14%

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

Fondsstrategie

Um sein Anlageziel zu erreichen, implementiert der Teilfonds eine quantitative Anlagestrategie (die "Strategie"), die über den BNP Paribas DEFI Equity US Long Net TR Index (der "Strategieindex") Long-Positionen in einem diversifizierten Korb aus Aktien von US-Märkten und Long- oder Short-Positionen in Futures eingeht. Die Strategie 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 % im Hinblick auf den Referenzindex des Teilfonds, den S&P 500 Total Return Index (Bloomberg-Code: SPTR Index), durch ein zusätzliches Engagement in Futures-Kontrakten aufrechtzuerhalten.

Der Teilfonds verfolgt eine aktive Anlagestrategie. Der Referenzindex des Teilfonds ist der S&P 500 Net Total Return Index, wobei nicht beabsichtigt wird, diesen nachzubilden. Die Umsetzung der Strategie erfolgt gemäß einer synthetischen Nachbildungspolitik über den Abschluss von OTC-Derivaten oder in Barmitteln durch die direkte Investition in den Korb aus Aktien, aus denen der Index besteht. Die synthetische Nachbildungspolitik impliziert, dass der Teilfonds nicht tatsächlich die zugrunde liegenden Wertpapiere des Index hält, sondern stattdessen OTC-Derivate verwendet, um die Wertentwicklung des Strategieindex zu erzielen. Der Teilfonds investiert zu jeder Zeit mindestens 75 % seines Nettovermögens in Aktien und/oder als Aktien gleichwertig behandelte Wertpapiere, die von Unternehmen aus beliebigen Ländern begeben werden.

Kommentar:

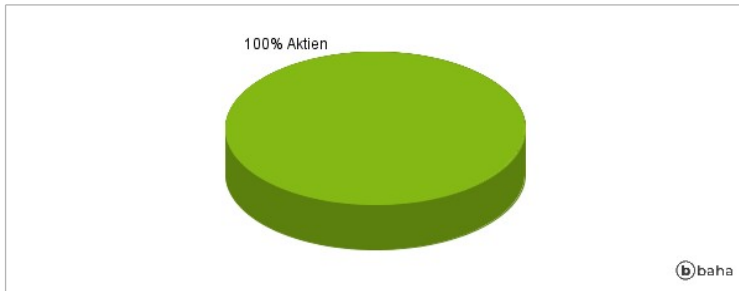
Fondsspezifische Information

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. Die Fondsbestimmungen des THEAM Quant Eq.US DEFI C USD wurden durch die FMA bewilligt. Der THEAM Quant Eq.US DEFI C USD 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..

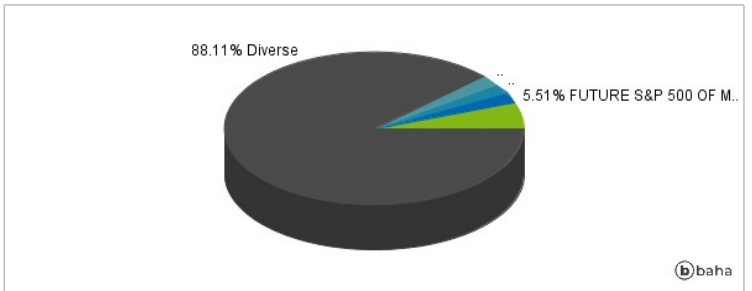
RISIKOHINWEISE: Die Informationen auf dieser Seite dienen ausschließlich zu Informationszwecken und sollten weder als Verkaufsangebot noch als Aufforderung zum Kauf des Wertpapiers oder einer Empfehlung zugunsten des Wertpapiers verstanden werden. Die baha GmbH und die BAWAG P.S.K. Bank für Arbeit und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

Factsheet erstellt von: www.baha.com

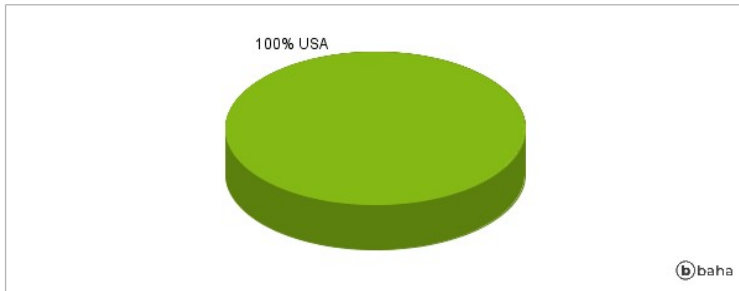
Anlagearten



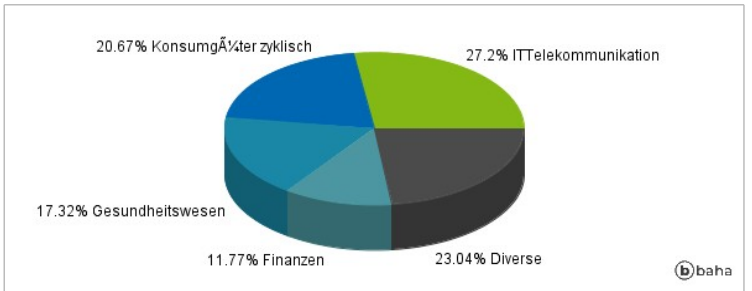
Größte Positionen



Länderverteilung



Branchenverteilung



Historische Daten: 05/2024

Erstellt: 19.05.2024 16:31