

# THEAM Quant Eq.US Premium Inc.C USD (LUI480596326)

KAG: BNP PARIBAS AM (LU)

ISIN: LUI480596326

Rücknahmepreis: 136,40 USD

Stand: 08.11.2024

Auflagedatum	10.12.18
Ausgabeaufschlag	3,00%
Konditionsdetails auf <a href="http://www.bawag.at">www.bawag.at</a>	
Fondsvolumen	27.08 Mio.
Ertragstyp	thesaurierend
Letzte Ausschüttung	keine
Anlageregion	USA
Fondstyp	AI Hedgefonds Single Strategy
Fondsmanager	Maxime PANEL



<b>Kapitalanlagegesellschaft</b>	
BNP PARIBAS AM (LU)	
10	
rue Edward Steichen 2540	
Luxemburg	
<a href="https://www.bnpparibas-am.com">https://www.bnpparibas-am.com</a>	

<b>Wertentwicklung*</b>		<b>1J</b>	<b>3J p.a.</b>	<b>5J p.a.</b>
Performance vor AGA		+11,95%	+5,52%	+5,44%
Performance nach max. AGA		+8,69%	+4,48%	+4,82%
<b>Kennzahlen*</b>		<b>1J</b>	<b>3J</b>	<b>5J</b>
Sharpe Ratio		1,85	0,42	0,22
Volatilität		+4,85%	+5,93%	+11,10%

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

## Fondsstrategie

Das Ziel des Teilfonds ist es, Einkommen und Kapitalwachstum durch die Umsetzung einer systematischen Optionsstrategie für eine Auswahl von US-Aktien zu erzielen, die auf die Erzielung von Einkünften in bullischen und mäßig bärischen Märkten abzielt. Der Teilfonds strebt ein Einkommen von 5 % pro Jahr an, die Erreichung dieses Ziels ist nicht garantiert.

Um sein Anlageziel zu erreichen, setzt der Teilfonds eine quantitative Anlagestrategie (die Strategie) um, die darin besteht, kurzfristige Put-Optionen für eine Auswahl von US-Aktien über den BNP Paribas Stock Put Write US Index (der Strategy Index) zu verkaufen. Das Modell, das zur Erstellung des Strategieindex verwendet wird, zielt auf Folgendes ab: - Auswahl von Aktien auf monatlicher Basis (Rebalancing) nach einem Prozess, der auf fundamentalen und Marktkriterien basiert. Ziel ist es, das Anlageuniversum zu untersuchen, um die Aktien zu identifizieren, die von einem nachhaltigen Geschäftsmodell, einer günstigen Kursdynamik, einer hohen durchschnittlichen Marktkapitalisierung, einer geringen Korrelation zu US-Aktien, einer attraktiven Bewertung der Optionsprämie und günstigen Handelsbedingungen am Optionsmarkt profitieren. Das Anlageuniversum des Strategy Index setzt sich aus den größten Kapitalisierungen an den US-Aktienmärkten zusammen, die zufriedenstellende Liquiditätsbedingungen bieten.

## Kommentar:

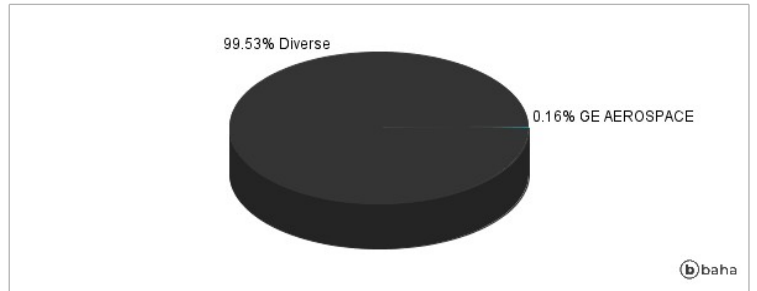
## Fondsspezifische Information

Im Rahmen der Anlagestrategie kann in wesentlichem Umfang in Derivate investiert werden. Die Fondsbestimmungen des THEAM Quant Eq.US Premium Inc.C USD wurden durch die FMA bewilligt. Der THEAM Quant Eq.US Premium Inc.C USD kann mehr als 35 % des Fondsvermögens in Wertpapiere/Geldmarktinstrumente folgender Emittenten investieren: 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..

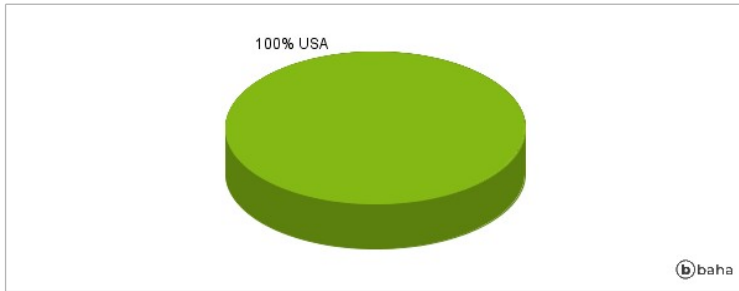
### Anlagearten



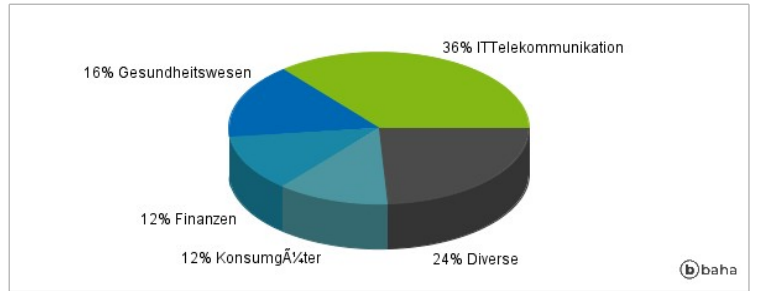
### Größte Positionen



### Länderverteilung



### Branchenverteilung



Historische Daten: 11/2024

Erstellt: 13.11.2024 04:04