

Systematic Dispersion Fund - Anteilklasse I (DE000A3DQ2R9)

KAG: Universal-Investment

ISIN: DE000A3DQ2R9

Rücknahmepreis: 99,17 EUR

Stand: 10.03.2025

Auflagedatum	09.06.23
Ausgabeaufschlag	-
Konditionsdetails auf www.bawag.at	
Fondsvolumen	65.74 Mio.
Ertragstyp	thesaurierend
Letzte Ausschüttung	keine
Anlageregion	weltweit
Fondstyp	AI Volatility
Fondsmanager	n.a
Kapitalanlagegesellschaft	
Universal-Investment	
Theodor-Heuss-Allee 70	
60486 Frankfurt am Main	
Deutschland	
https://www.universal-investment.com	



Wertentwicklung*	1J	3J p.a.	5J p.a.
Performance vor AGA	+0,72%	-	-
Performance nach max. AGA	+0,72%	-	-
Kennzahlen*	1J	3J	5J
Sharpe Ratio	-0,22	-	-
Volatilität	+8,46%	-	-

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

Fondsstrategie

Der Fonds ist aktiv gemanagt. Der Fonds strebt als Anlageziel die Erzielung von Renditen bei angemessenen Risiken und Berücksichtigung von ökologischen und sozialen Aspekten an. Um dies zu erreichen, investiert der Fonds in verschiedene Vermögensgegenstände. Der Fonds investiert in ein Basisportfolio und einen Total Return Swap auf eine Dispersion Strategie auf den US-Markt. Das Basisportfolio wird überwiegend in auf Euro lautende Staatsanleihen (Fixed oder Floating Rate Notes) mit kurzer (verbleibender) Laufzeit (bis 2 Jahre) sowie in Geldmarktinstrumente investiert. Für das Basisportfolio ist die Sicherheit der Hauptaspekt, weshalb nur in Investment-Grade-Anleihen investiert wird. Grundsätzlich gilt für die Auswahl des Basisportfolios die Anlageverordnung nach dem Versicherungsaufsichtsgesetz. Neben dem Basisportfolio wird der Fonds in einen Total Return Swap auf einer Dispersionsstrategie investieren, welche darauf abzielt von Unterschieden in der Index- und Einzelaktienvolatilität zu profitieren. Die Dispersion Strategie macht sich die relativen Wertunterschiede bei den impliziten Volatilitäten zwischen einem Index und den einzelnen Indexkomponenten zunutze. Es werden Optionen auf einen Index verkauft /gekauft und Optionen auf Einzelaktien gekauft /verkauft. Als Renditetreiber fungieren Volatilität und Korrelation der Einzelaktien. Dieser Fonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale im Sinne des Artikel 8 der Offenlegungs-Verordnung (Verordnung (EU) 2019/2088). Der Fonds kann Derivatgeschäfte tätigen, um Vermögenspositionen abzusichern oder um höhere Wertzuwächse zu erzielen. Der Fonds wird nicht mit Bezug auf eine Benchmark gemanagt.

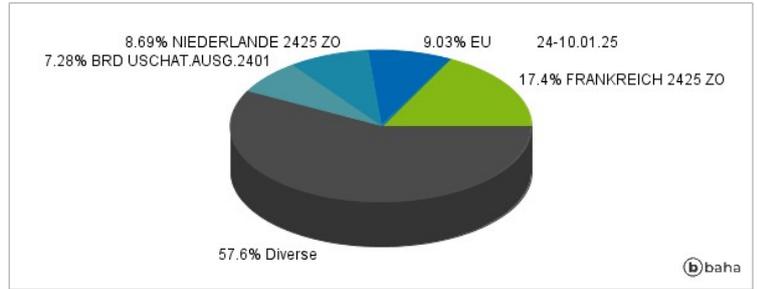
Kommentar:

Fondsspezifische Information

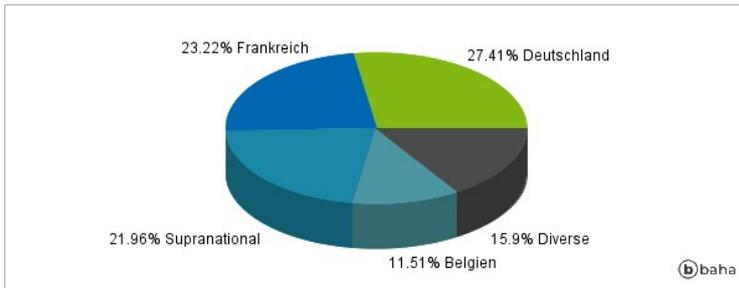
Anlagearten



Größte Positionen



Länderverteilung



Branchenverteilung



Historische Daten: 03/2025

Erstellt: 12.03.2025 08:03