

THEAM QUANT Equity Europe DEFI | Capitalisation (LUI480601266)

KAG: BNP PARIBAS AM (LU)

ISIN: LUI480601266

Rücknahmepreis: 148,38 EUR

Stand: 01.10.2024

| | |
|---|---------------|
| Auflagedatum | 21.03.19 |
| Ausgabeaufschlag | - |
| Konditionsdetails auf www.bawag.at | |
| Fondsvolumen | 10.48 Mio. |
| Ertragstyp | thesaurierend |
| Letzte Ausschüttung | keine |
| Anlageregion | Europa |
| 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 | | +22,73% | +8,81% | +7,82% |
| Performance nach max. AGA | | +22,73% | +8,81% | +7,82% |
| Kennzahlen* | | 1J | 3J | 5J |
| Sharpe Ratio | | 1,95 | 0,40 | 0,26 |
| Volatilität | | +10,01% | +13,77% | +17,61% |

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

Fondsstrategie

Der Teilfonds ist bestrebt, den Wert seiner Vermögenswerte mittelfristig durch ein Engagement in einem dynamischen Korb aus Aktien von Unternehmen zu steigern, die auf europäischen Märkten notiert sind oder dort ihre Geschäftstätigkeit ausüben. Die Komponenten des Korbs werden mit Hilfe einer systematischen Auswahlmethode ausgewählt, die auf einer Fundamentalanalyse von Unternehmen basiert.

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 STOXX Europe 600 Net Return EUR Index (Bloomberg-Code: SXXR Index), durch ein zusätzliches Engagement in Futures-Kontrakten aufrechtzuerhalten

Kommentar:

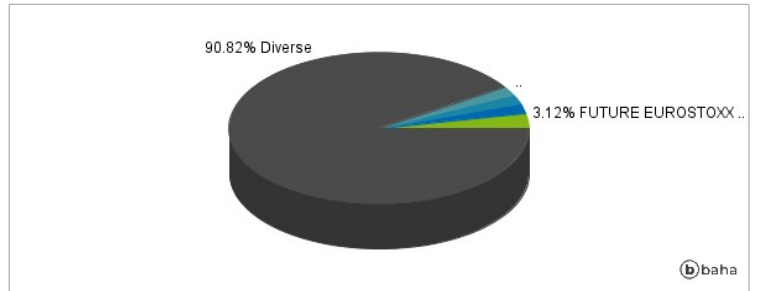
Fondsspezifische Information

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 Equity Europe DEFI J Capitalisation wurden durch die FMA bewilligt. Der THEAM QUANT Equity Europe DEFI J Capitalisation 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..

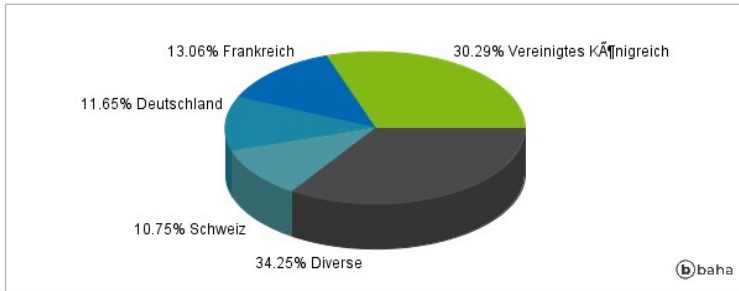
Anlagearten



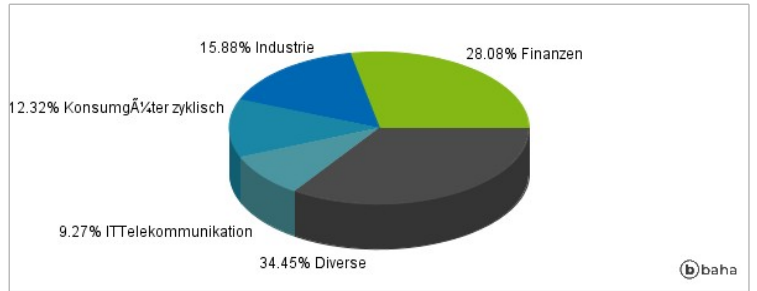
Größte Positionen



Länderverteilung



Branchenverteilung



Historische Daten: 10/2024

Erstellt: 05.10.2024 04:59