

MontLake Volatility Arbitrage UCITS Fund EI (IE000X3IY4G0)

KAG: Waystone M.Co.(IE)

ISIN: IE000X3IY4G0

Rücknahmepreis: 98,71 EUR

Stand: 11.03.2025

Auflagedatum	18.09.23
Ausgabeaufschlag	4,00%
Konditionsdetails auf www.bawag.at	
Fondsvolumen	39,49 Mio.
Ertragstyp	thesaurierend
Letzte Ausschüttung	keine
Anlageregion	weltweit
Fondstyp	AI Volatility
Fondsmanager	Simon Khalili, Fabiano...



Kapitalanlagegesellschaft	
Waystone M.Co.(IE)	
35 Shelbourne Road	
D04 A4E0 Dublin	
Irland	
https://www.waystone.com/	

Wertentwicklung*		1J	3J p.a.	5J p.a.
Performance vor AGA		+1,15%	-	-
Performance nach max. AGA		-2,74%	-	-
Kennzahlen*		1J	3J	5J
Sharpe Ratio		-0,16	-	-
Volatilität		+8,54%	-	-

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

Fondsstrategie

Das Anlageziel des Teilfonds besteht darin, eine positive absolute Rendite zu erzielen. Der Teilfonds strebt die Erreichung seines Anlageziels an, indem er auf Basis einer langen oder kurzen Anlagestrategie in Finanzderivate ("FDI") investiert, einschließlich Indexoptionen und Indexfutures, um eine Marktexposition zu erlangen. Die FDI, in die der Teilfonds investieren kann, können entweder OTC-FDI sein oder an einem anerkannten Markt notiert oder gehandelt werden. Der Teilfonds kann auch eine Exposition gegenüber Staatsanleihen erreichen, die von Regierungen oder überstaatlichen Einrichtungen begeben oder garantiert werden und einen festen oder variablen Zinssatz aufweisen und von einer anerkannten Rating-Agentur mit AAA bewertet werden. Der Teilfonds hat keinen besonderen geografischen Schwerpunkt und investiert stattdessen weltweit, ohne Branchen- oder Sektorenschwerpunkt. Vielmehr sucht er nach den höchsten Liquiditätsniveaus unter den entwickelten Marktindexoptionen. Der Teilfonds kann sich auch in den Indizes engagieren, indem er bis zu einem maximalen Gesamtengagement von 10 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds in offene, nicht in den USA ansässige börsengehandelte Fonds investiert ("ETFs"). Der Teilfonds kann auch direkt in Exchange Traded Notes ("ETNs") investieren, die die Indizes nachbilden und die Liquiditäts- und anderen Anforderungen der OGAW-Vorschriften erfüllen. Investitionen in ETNs werden erfolgen, wenn dies für den Teilfonds effizienter und kostengünstiger ist. Der Teilfonds kann, vor einer Wiederanlage oder zur Unterstützung seiner FDI-Positionen, in Zeiten extremer Volatilität oder wenn Marktbedingungen es erfordern und wenn es als angemessen für das Anlageziel des Teilfonds erachtet wird, bis zu 100% des Nettoinventarwerts des Teilfonds in Bargeld, Bargeldäquivalente (einschließlich, aber nicht beschränkt auf, Bareinlagen und Einlagenzertifikate) und Geldmarktinstrumente, einschließlich US-Schatzschuldvorschreibungen wie Schatzwechsel, -noten oder -anleihen, investieren, die von einer OECD-Regierung, ihren Behörden oder Instrumentalitäten oder von einer überstaatlichen Einheit mit Investment-Grade-Rating, bewertet von einer anerkannten Ratingagentur, ausgegeben oder garantiert werden.

Kommentar:

Fondsspezifische Information

Im Rahmen der Anlagestrategie kann in wesentlichem Umfang in Derivate investiert werden. Die Fondsbestimmungen des MontLake Volatility Arbitrage UCITS Fund EI wurden durch die FMA bewilligt. Der MontLake Volatility Arbitrage UCITS Fund EI kann mehr als 35 % des Fondsvermögens in Wertpapiere/Geldmarktinstrumente folgender Emittenten investieren: by any EU Member State, its local authorities, non-Member States or public international bodies of which one or more EU Member States are members or by Australia, Canada, Hong Kong, Japan, New Zealand, Switzerland, United States or any of the following: European Investment Bank, European Bank for Reconstruction and Development, International Finance Corporation, International Monetary Fund, Euratom, The Asian Development Bank, European Central Bank, Council of Europe, Eurofima, African Development Bank, International Bank for Reconstruction and Development (The World Bank), The Inter American Development Bank, European Union, Federal National Mortgage Association (Fannie Mae), Federal Home Loan Mortgage Corporation (Freddie Mac), Government National Mortgage Association (Ginnie Mae), Student Loan Marketing Association (Sallie Mae), Federal Home Loan Bank, Federal Farm Credit Bank, Tennessee Valley Authority, Straight-A Funding LLC, OECD Governments (provided the relevant issues are investment grade), Government of Brazil (provided the issues are of investment grade), Government of the People's Republic of China, Government of India (provided the issues are of investment grade), Government of Singapore..

Anlagearten



Größte Positionen



Länderverteilung



Branchenverteilung



Historische Daten: 03/2025

Erstellt: 12.03.2025 22:33