

# THEAm QUANT - Alpha Commodity Privilege EUR RH Capitalisat

KAG: BNP PARIBAS AM (LU)

ISIN: LU2526007955

Rücknahmepreis: 98,13 EUR

Stand: 08.01.2025

|  |                |
|--|----------------|
| Auflagedatum   | 20.10.22       |
| Ausgabeaufschlag   | 3,00%          |
| Konditionsdetails auf <a href="http://www.bawag.at">www.bawag.at</a> |                |
| Fondsvolumen   | 87.13 Mio.     |
| Ertragstyp   | thesaurierend  |
| Letzte Ausschüttung  | keine          |
| Anlageregion   | weltweit       |
| Fondstyp   | AI Commodities |
| Fondsmanager   | Maxime Panel   |



## Kapitalanlagegesellschaft

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

| Wertentwicklung*          | 1J      | 3J p.a. | 5J p.a. |
|---------------------------|---------|---------|---------|
| Performance vor AGA       | -8,04%  | -       | -       |
| Performance nach max. AGA | -10,72% | -       | -       |

  

| Kennzahlen*  | 1J     | 3J | 5J |
|--------------|--------|----|----|
| Sharpe Ratio | -1,34  | -  | -  |
| Volatilität  | +8,12% | -  | -  |

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

## Fondsstrategie

Ziel des Teilfonds ist die mittelfristige Wertsteigerung der Vermögenswerte mithilfe quantitativer Anlagestrategien bezüglich mehrerer Rohstoffmärkte, aber ohne die Rohstoffsektoren Landwirtschaft und Viehzucht. Um sein Anlageziel zu erreichen, setzt der Teilfonds eine Strategie (die "Strategie") um, wobei er seine Vermögenswerte auf verschiedene Unterstrategien aufteilt, indem er innerhalb eines ausgewogenen risikobereinigten Portfolios einzelne Renditequellen aus Marktgelegenheiten oder -ineffizienzen über verschiedene Rohstoffmarktsektoren hinweg identifiziert, jedoch die Rohstoffsektoren Landwirtschaft und Viehzucht ausschließt. Insbesondere kann der Teilfonds über Finanzindizes in Laufzeitstruktur-, Momentum-, Relative-Value-, notierten optionsbasierten und Long-Short-Strategien engagiert sein. Die monatlich den Unterstrategien über Finanzindizes zugeteilten Gewichtungen werden so gestaltet, dass jeder dieser Finanzindizes gleichermaßen zum Gesamtrisiko beiträgt. So wird ein risikogestreutes Portfolio anvisiert. Die Strategie ist zweifach gehebelt, das heißt die den Finanzindizes zugewiesene Gesamtgewichtung wird jeden Monat auf 2 gesetzt.

## 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 - Alpha Commodity Privilege EUR RH Capitalisation wurden durch die FMA bewilligt. Der THEAm QUANT - Alpha Commodity Privilege EUR RH Capitalisation kann mehr als 35 % des Fondsvermögens in Wertpapiere/Geldmarktinstrumente folgender Emittenten investieren: 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: 01/2025

Erstellt: 10.01.2025 00:26