

AQR Delphi Long-Short Equity UCITS Fund IAE2 EUR (LUI842777358)

KAG: FundRock M. Co.

ISIN: LUI842777358

Rücknahmepreis: 210,38 EUR

Stand: 08.05.2025

Auflagedatum	26.10.18
Ausgabeaufschlag	-
Konditionsdetails auf www.bawag.at	
Fondsvolumen	-
Ertragstyp	thesaurierend
Letzte Ausschüttung	keine
Anlageregion	weltweit
Fondstyp	AI Hedgefonds Single Strategy
Fondsmanager	Andrea Frazzini, Michele...

Kapitalanlagegesellschaft

FundRock M. Co.
33 Rue de Gasperich
L-5826 Hesperange
Luxemburg
https://www.fundrock.com



Wertentwicklung*

	1J	3J p.a.	5J p.a.
Performance vor AGA	+20,42%	-	-
Performance nach max. AGA	+20,42%	-	-

Kennzahlen*

	1J	3J	5J
Sharpe Ratio	1,46	-	-
Volatilität	+12,51%	-	-

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

Fondsstrategie

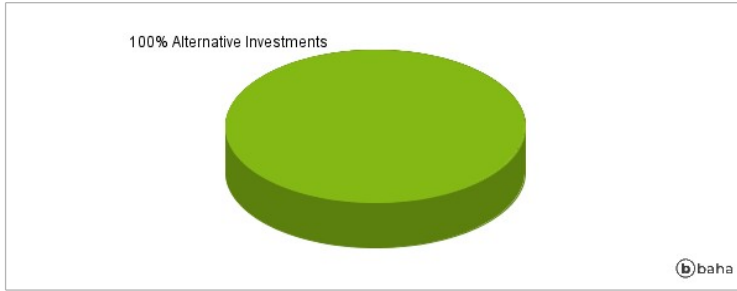
Der Fonds ist bestrebt, Anlegern Renditen aus seinen Long- und Shortpositionen in aktienbezogenen Wertpapieren zu bieten. Der Anlageansatz des Fonds sieht vor, Long-Positionen in attraktiv bewerteten und qualitativ hochwertigen Vermögenswerten mit niedrigem Beta zu halten (d. h. der Fonds kann direkt Positionen halten, deren Wert entsprechend ihrem Marktwert steigen oder fallen kann) und Short-Positionen in teuren Vermögenswerten geringer Qualität mit hohem Beta einzugehen (d. h. der Fonds nutzt Derivate, um vom Wertverlust von Anlagen zu profitieren). Der Fonds bewirbt gute ökologische, soziale und Unternehmensführungsmerkmale ("ESG") und berücksichtigt ESG-Faktoren, indem er zum Beispiel die ca. 10 % der Unternehmen mit den schlechtesten ESG-Bewertungen ausschließt und Titel mit Bezug zu fossilen Brennstoffen aus dem Long-Segment des Portfolios ausschließt. Vor dem Hintergrund der Anwendung von ESG-Faktoren auf die Anlagestrategie nimmt der Fonds Offenlegungen gemäß Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor vor. "Beta" ist eine Maßzahl für die Höhe des Systemrisikos, das ein Vermögenswert im Vergleich zu einem globalen Aktienmarktindex aufweist. Der Fonds strebt ein durchschnittliches Risikoengagement von 0,4 bis 0,6 in einem zusammengesetzten globalen Aktienmarktindex ("Benchmark") an. Die Benchmark setzt sich zusammen aus dem MSCI World Net Total Return Index in GBP abgesichert mit 50 % und dem SONIA mit 50 %. Der Fonds wird Finanzinstrumente, darunter unter anderem Barmittel, Aktien, Futures (Kontrakte zum Kauf oder Verkauf eines Vermögenswerts zu einem bestimmten Preis in der Zukunft), Swaps (Derivatkontrakte, bei denen zwei Parteien die Cashflows oder Verbindlichkeiten oder Referenzvermögenswerte tauschen) sowie Währungstermingeschäfte nutzen.

Kommentar:

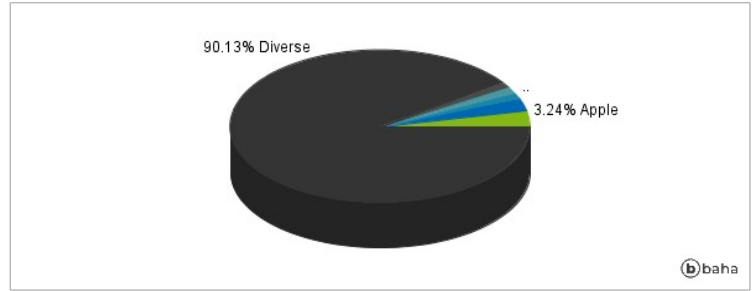
Fondsspezifische Information

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 AQR Delphi Long-Short Equity UCITS Fund IAE2 EUR wurden durch die FMA bewilligt. Der AQR Delphi Long-Short Equity UCITS Fund IAE2 EUR kann mehr als 35 % des Fondsvermögens in Wertpapiere/Geldmarktinstrumente folgender Emittenten investieren: by a Member State of the EU, by its local authorities, by any other Member State of the OECD such as the U.S., by certain non-Member States of the OECD (currently Brazil, Indonesia, Russia and South Africa) or by a public international body of which one or more Member State(s) of the EU are member(s) (collectively, the "Public Issuers").

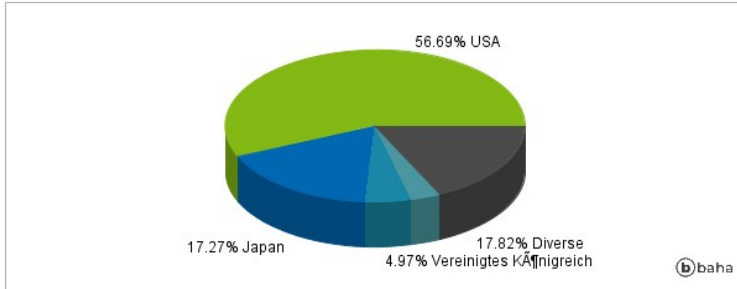
Anlagearten



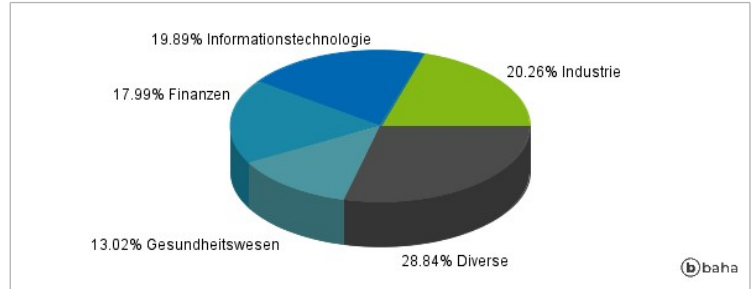
Größte Positionen



Länderverteilung



Branchenverteilung



Historische Daten: 05/2025

Erstellt: 12.05.2025 09:40