THEAM QUANT MULTI ASSET DIVERSIFIED Privilege Capitalisation (

KAG: BNP PARIBAS AM Eur. | ISIN: LU1353184184 | Rücknahmepreis: 68,39 EUR | Stand: 17.04.2025

Auflagedatum	13.11.17
Ausgabeaufschlag	3,00%
Konditionsdetails auf www.easybank.at	
Fondvolumen	22.24 Mio.
Ertragstyp	thesaurierend
Letzte Ausschüttung	keine
Anlageregion	weltweit
Fondstyp	AI Hedgefonds Single Strategy
Fondsmanager	Solene Deharbonnier

Kapitalanlagegesellschaft

BNP PARIBAS AM Eur.
14 rue Bergère
75009 Paris
Frankreich
https://www.bnpparibas-am.com

Wertentwicklung*	1J	3J p.a.	5J p.a.
Performance vor AGA	-17,68%	-10,72%	-3,41%
Performance nach max. AGA	-20,08%	-11,59%	-3,98%

Kennzahlen*	1J	3J	5J
Sharpe Ratio	-1,62	-1,21	-0,54
Volatilität	+12,25%	+10,68%	+10,34%

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

Fondsstrategie

Ziel des Teilfonds ist es, den Wert seiner Vermögenswerte mittelfristig durch ein Engagement in einem in Euro abgesicherten diversifizierten Korb aus Long/Short-Positionen zu steigern, dessen Komponenten mithilfe einer systematischen Auswahlmethode ausgewählt werden, die auf verschiedenen Anlageklassen basiert. Das Engagement in dem dynamischen Korb ist angepasst, um die jährliche Volatilität des Teilfonds auf einem Zielniveau von 10 % zu halten.
Das Anlageuniversum der Strategie setzt sich aus vier Anlageklassen zusammen: (i) Aktien, (ii) festverzinsliche Anlagen einschließlich Schuldtitel, (iii) Währungen und (iv) Rohstoffindizes. Der zur Auswahl der Basiswerte aus den einzelnen Anlageklassen verwendete Prozess basiert auf Kriterien in Zusammenhang mit geografischer Diversifizierung, Liquidität und Transparenz. Es wird täglich eine automatische Umschichtung zwischen den verschiedenen Basiswerten mithilfe eines Algorithmus vorgenommen. Eine optimale Diversifizierung wird über die Anwendung eines systematischen Risiko-Rendite-Optimierungsmodells angestrebt, das auf historisch beobachteten Niveaus basiert (Wertentwicklung, Volatilität und Korrelation). Die Umsetzung der Strategie erfolgt über den Finanzindex (der Strategieindex) BNP Paribas Cross Asset Trend Vol 10% (Bloomberg-Code: BNPICT10 Index) Der Strategieindex beruht auf einem systematischen, von BNP Paribas entwickelten Modell. Er wird bis zu einmal täglich über technische Anpassungen mittels systematischer Algorithmen neu gewichtet. Diese Methodik berücksichtigt bestimmte Gebühren, die die Nachbildung, Neugewichtung und Fixkosten abdecken.

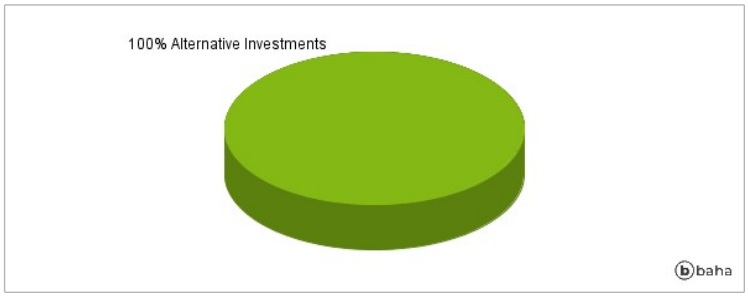
Kommentar:

Fondsspezifische Information

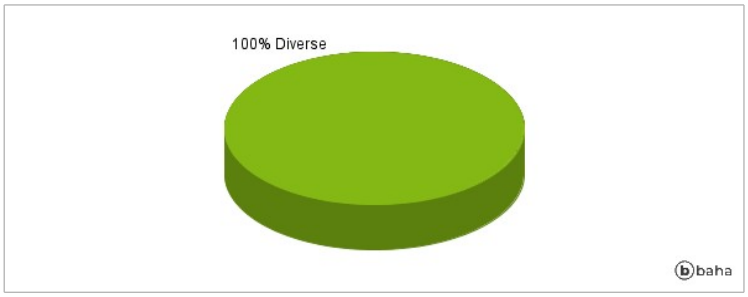
Im Rahmen der Anlagestrategie kann in wesentlichem Umfang in Derivate investiert werden. Aufgrund der Zusammensetzung des Fonds oder der verwendeten Managementtechniken weist der Fonds eine erhöhte Volatilität auf, d.h. die Anteilswerte sind auch innerhalb kurzer Zeiträume großen Schwankungen nach oben und nach unten ausgesetzt, wobei auch Kapitalverluste nicht ausgeschlossen werden können. Die Fondsbestimmungen des THEAM QUANT MULTI ASSET DIVERSIFIED Privilege Capitalisation wurden durch die FMA bewilligt. Der THEAM QUANT MULTI ASSET DIVERSIFIED Privilege 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..

RISIKOHINWEISE: Die Informationen auf dieser Seite dienen ausschließlich zu Informationszwecken und sollten weder als Verkaufsangebot noch als Aufforderung zum Kauf des Wertpapieres oder einer Empfehlung zugunsten des Wertpapieres verstanden werden. Die baha GmbH und die BAWAG P.S.K. Bank für Arbeit und Wirtschaft und Österreichische Postsparkasse Aktiengesellschaft übernehmen trotz sorgfältigster Recherche keinerlei Haftung für die Richtigkeit der angegebenen Daten.
Factsheet erstellt von: www.baha.com

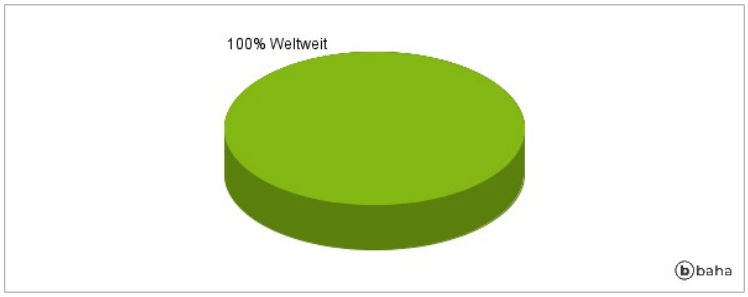
Anlagearten



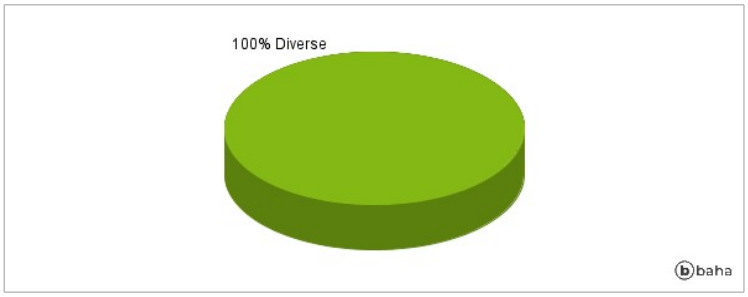
Größte Positionen



Länderverteilung



Branchenverteilung



Historische Daten: 04/2025

Erstellt: 23.04.2025 11:18

RISIKOHINWEISE: Die Informationen auf dieser Seite dienen ausschließlich zu Informationszwecken und sollten weder als Verkaufsangebot noch als Aufforderung zum Kauf des Wertpapieres oder einer Empfehlung zugunsten des Wertpapieres verstanden werden. Die baha GmbH und die BAWAG P.S.K. Bank für Arbeit und Wirtschaft und Österreichische Postsparkasse Aktiengesellschaft übernehmen trotz sorgfältigster Recherche keinerlei Haftung für die Richtigkeit der angegebenen Daten.
Factsheet erstellt von: www.baha.com