

# Theam Quant Eur.Target Premium I (LU2051090137)

KAG: BNP PARIBAS AM Eur.

ISIN: LU2051090137

Rücknahmepreis: 164,98 EUR

Stand: 08.08.2024

Auflagedatum	20.03.20
Ausgabeaufschlag	-
Konditionsdetails auf <a href="http://www.easybank.at">www.easybank.at</a>	
Fondsvolumen	272.91 Mio.
Ertragstyp	ausschüttend
Letzte Ausschüttung	keine
Anlageregion	Europa
Fondstyp	AI Hedgefonds Single Strategy
Fondsmanager	RICCI Fabrice
<b>Kapitalanlagegesellschaft</b>	
BNP PARIBAS AM Eur.	
14 rue Bergère	
75009 Paris	
Frankreich	
<a href="https://www.bnpparibas-am.com">https://www.bnpparibas-am.com</a>	



<b>Wertentwicklung*</b>		<b>1J</b>	<b>3J p.a.</b>	<b>5J p.a.</b>
Performance	vor AGA	+8,22%	+11,25%	-
Performance	nach max. AGA	+8,22%	+11,25%	-
<b>Kennzahlen*</b>		<b>1J</b>	<b>3J</b>	<b>5J</b>
Sharpe Ratio		0,98	0,70	-
Volatilität		+4,78%	+11,03%	-

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

## Fondsstrategie

Das Ziel des Teilfonds ist die Erwirtschaftung von Erträgen und Kapitalzuwachs. Dies geschieht durch die Umsetzung einer dynamischen systematischen Optionsstrategie im EURO STOXX 50 Index (Bloomberg-Code: SX5E Index), die darauf abzielt, in Haussemärkten und moderaten Baissemärkten Erträge zu erwirtschaften und gleichzeitig potenzielle Wertverluste des Teilfonds zu begrenzen.

Um sein Anlageziel zu erreichen, setzt der Teilfonds eine tägliche dynamische Anlagestrategie (die Strategie) um, die sich auf zwei Säulen der Wertentwicklung stützt: (a) ein Short-Engagement in kurzfristigen Out-of-the-Money-Put-Optionen auf den Euro Stoxx 50 Index (Bloomberg-Code: SX5E Index). Diese Optionsstrategie ermöglicht es dem Teilfonds, Erträge zu generieren, und ist insbesondere in Haussemärkten, stabilen Märkten oder ziemlich richtungslosen Märkten angemessen, kann bei plötzlichen längeren Abwärtsphasen jedoch zu Verlusten führen. (b) ein dynamisches Long-Engagement in einer Kombination von Put-Optionen auf den Euro Stoxx 50 Index (Bloomberg-Code: SX5E Index). Diese Strategie zielt darauf ab, die Auswirkungen fallender Märkte und damit die Volatilität des Teilfonds zu begrenzen, und ist insbesondere in ausgeprägten Baissemärkten angebracht.

## Kommentar:

## Fondsspezifische Information

Im Rahmen der Anlagestrategie kann in wesentlichem Umfang in Derivate investiert werden. Die Fondsbestimmungen des Theam Quant Eur.Target Premium I wurden durch die FMA bewilligt. Der Theam Quant Eur.Target Premium I 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: 08/2024

Erstellt: 12.08.2024 17:42