

THEAM Quant - Equity Europe Factor Defensive I EUR Capitalisation

Categoria Morningstar™

Alt - Volatilità

Benchmark Morningstar
Not Categorized
Usato nel Report
Benchmark Dichiarato

STOXX Europe 600 NR EUR

Morningstar Rating™

Senza rating

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The objective of the Sub-fund is to provide capital growth (i) by being exposed to a basket of European equities and (ii) by implementing a systematic options strategy which aims at reducing risk by minimizing volatility in the Sub-fund. The Sub-fund will not invest more than 10% of its net assets in units or shares of UCITS or other UCIs.

Rendimenti

Misure di Rischio

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	0,37
3Y Beta	-	3Y Std Dev	9,10
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

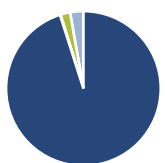
Rend. Cumulati %

Periodo	Fondo
3-Mesi	4,99
6-Mesi	8,13
1-Anno	13,36
3-Anni Ann.ti	5,25
5-Anni Ann.ti	3,69
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 03/02/2025

Rendimenti

Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %				
2025	-	-	-	-
2024	4,19	1,90	4,21	-0,61
2023	6,66	2,38	1,06	4,15
2022	-5,98	-7,51	-4,27	3,23
2021	8,91	6,58	-1,47	7,09

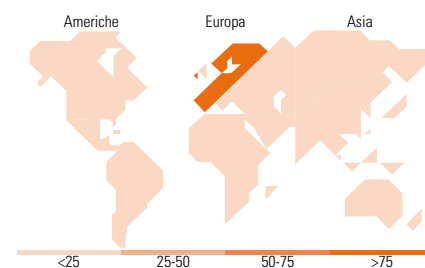
Portafoglio 31/12/2024


Asset Allocation %	Netta
Azioni	100,68
Obbligazioni	0,13
Liquidità	2,13
Altro	-2,94

Fixed Income
Style Box™

Quantità Credito		Sensibilità ai Tassi	
Alto	Basso	Bassa	Alta

Duration Effettiva
Maturità effettiva
Qualità Credito Media

Fondo

Titoli principali

Nome	Settore	%
AXA SA		9,53
Danone SA		9,51
Orange SA		9,45
Credit Agricole SA		7,87
Societe Generale SA		4,77
UniCredit SpA		4,75
Sanofi SA		4,74
Veolia Environnement SA		4,73
Intesa Sanpaolo		4,72
SCOR SE Act. Prov. Regpt.		4,72
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		64,80
Numero Complessivo di Titoli Azionari		18
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		0

Fixed Income Sector Weightings %

Settore	Fondo
Governativo	-0,01
Societario	5,63
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	94,35
Derivati	0,04
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	0,00
Da 0 a 4 cedole	0,00
Da 4 a 6 cedole	0,00
Da 6 a 8 cedole	0,00
Da 8 a 10 cedole	0,00
Da 10 a 12 cedole	0,00
Oltre 12 cedole	0,00

Ripartizione Geografica %

Regione	Fondo
America	0,00
Stati Uniti	0,00
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,00
Europa	100,00
Regno Unito	0,00
Europa Occidentale - Euro	100,00
Europa Occidentale - Non Euro	0,00
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
Asia	0,00
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,00
Asia - Emergente	0,00

Anagrafica

Società di Gestione	BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe	Patrimonio Classe (Mln)	57,27 EUR	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+33 (0)145 252 525	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	www.bnpparibas-am.fr	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	0,80%
Data di Partenza	25/01/2018	UCITS	Si	Spese correnti	0,84%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	25/01/2018	ISIN	LU1685632132		
NAV (03/02/2025)	EUR 120,81				
Patrimonio Netto (Mln)	66,58 EUR				

(31/12/2024)