

AMUNDI FUNDS VOLATILITY EURO - A EUR

MONATLICHES
FACTSHEET

31/01/2020

WERBUNG ■

Wesentliche Informationen (Quelle : Amundi)

Nettoinventarwert (NAV) : (C) 97,61 (EUR)
(D) 88,03 (EUR)
Datum des NAV : 31/01/2020
ISIN-Code : (C) LU0272941971
(D) LU0272942359
WKN : A0ML43
Fondsvolumen : 172,50 (Millionen EUR)
Referenzwährung des Teilfonds : EUR
Referenzwährung der Anteilsklasse : EUR
Referenzindex :
Nicht an einer Benchmark orientierter Fonds

Anlageziel

Erzielen einer positiven Rendite unter jeder Art von Marktbedingungen (Absolute-Return-Strategie). Insbesondere strebt der Teilfonds an, den EONIA (compounded daily) Index über die empfohlene Haltedauer um +3 % p. a. zu übertreffen (nach Abzug der geltenden Gebühren) und gleichzeitig ein kontrolliertes Risiko zu bieten.
Der Teilfonds ist bestrebt, den Value-at-risk (VaR) von 35 % nicht zu überschreiten (zwölfmonatiger Ex-ante-VaR von 95 %).
Der Teilfonds investiert in an der Börse gehandelte Optionen im Euro Stoxx 50 Index mit einer durchschnittlichen Laufzeit von einem Jahr. Alle Vermögenswerte, die nach Erreichen des angestrebten Volatilitätsengagements des Teilfonds nicht investiert bleiben, werden in Geldmarktinstrumenten angelegt. Der Teilfonds kann bis zu 100 % seines Nettovermögens in diese liquiden Anlagen investieren.
Der Teilfonds setzt in großem Umfang Derivate zur Reduzierung verschiedener Risiken, für eine effiziente Portfolioverwaltung und zum Zwecke von (Long- oder Short-) Engagements in verschiedenen Vermögenswerten, Märkten oder anderen Anlagemöglichkeiten (einschließlich Derivaten mit Schwerpunkt auf Aktien, Zinssätzen, Devisen und Dividenden) ein.
Der Teilfonds zielt nicht darauf ab, den Referenzindex nachzubilden, und kann daher erheblich von diesem abweichen.
Das Anlageteam analysiert die Muster der Marktvolatilität, um die Richtung und das Ausmaß des Volatilitätsengagements zu bestimmen: positives Engagement, wenn die Volatilität gering ist und ein Anstieg erwartet wird, negatives Engagement, wenn die Volatilität hoch ist und ein Rückgang erwartet wird. Es versucht zudem, von kurzfristigen Schwankungen der Volatilität („Volatilität der Volatilität“) zu profitieren.

Wertentwicklung

Performanceentwicklung (Basis: 100) * von 30/01/2015 bis 31/01/2020



Wertentwicklung (nach Abzug von Gebühren) *

seit dem	seit dem	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	seit dem
	31/12/2019	31/12/2019	31/10/2019	31/01/2019	31/01/2017	30/01/2015	14/11/2006
Portfolio ohne Ausgabeaufschlag	-2,73%	-2,73%	-3,79%	-8,06%	-26,53%	-27,00%	-2,38%

Wertentwicklung des Fonds *

	2016	2017	2018	2019	2020
Per	29/01/2016	31/01/2017	31/01/2018	31/01/2019	31/01/2020
seit dem	30/01/2015	29/01/2016	31/01/2017	31/01/2018	31/01/2019
Portfolio ohne Ausgabeaufschlag	3,97%	-4,44%	-15,06%	-5,92%	-8,06%
Portfolio mit Ausgabeaufschlag	-0,51%	-4,44%	-15,06%	-5,92%	-8,06%

* Bei einer Anlage (zum Zeitpunkt des Beginns der Darstellung der Wertentwicklung) von 104,5 EUR und einem Ausgabeaufschlag in Höhe von 4,5% werden 100 EUR in den Teilfonds investiert. Da der Ausgabeaufschlag nur im 1. Jahr anfällt, unterscheidet sich die Darstellung der Wertentwicklung nur in diesem Jahr. Andere ertragsmindernde Kosten wie individuelle Konto- und Depotgebühren sind in der Darstellung nicht berücksichtigt. Die angegebene Wertentwicklung deckt für jedes Kalenderjahr vollständige 12-Monats-Zeiträume ab. Die Wertentwicklung in der Vergangenheit bietet keine Garantie für den künftigen Wertverlauf. Der Wert der Anlagen kann in Abhängigkeit von der Marktentwicklung steigen oder fallen. Quelle : Amundi.

Risiko- und Renditeprofil (SRRI)



1 Niedrige Risiken, potenziell niedrigere Erträge

7 Hohe Risiken, potenziell höhere Erträge

Das SRRI entspricht dem in den wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) angeführten Risiko- und Renditeprofil. Die niedrigste Kategorie kann nicht mit einer „risikofreien Anlage“ gleichgesetzt werden. Sie ist nicht garantiert und kann sich im Laufe der Zeit verändern.

Hauptmerkmale

Fondsstruktur : OGAW
Anwendbares Recht : nach luxemburgischem Recht
Gründungsdatum des Teilfonds : 13/11/2006
Auflagedatum der Anlageklasse : 13/11/2006
Ertragsverwendung : (C) Thesaurierend
(D) Ausschüttend
Mindestanlagebetrag bei Erst-/Folgezeichnung :
1 Tausendstel-Anteil(e)/Aktie(n)
Ausgabeaufschlag (maximal) : 4,50%
Ausgabeaufschlag (laufend) : 4,50%
Verwaltungsvergütung p.a. : 1,20%
Laufende Kosten : 1,45% (Geschätzt 01/06/2019)
Rücknahmeabschlag (maximal) : 0,00%
Empfohlene Mindestanlagedauer : 3 Jahre
Erfolgsabhängige Gebühr : Ja
Performancevergütung (% pro Jahr) : 20,00 %
über : EONIA (compounded daily) index + 3%

Gleitende(r) Indikator(en)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Portfolio Volatilität	6,47%	7,74%	6,78%

Die Volatilität ist ein statistischer Indikator, der die Schwankungen eines Vermögenswerts um seinen Mittelwert misst. Beispielsweise entspricht eine Marktschwankung von +/- 1,5% pro Tag einer Volatilität von 25% pro Jahr.

AMUNDI FUNDS VOLATILITY EURO - A EUR

MONATLICHES
FACTSHEET

31/01/2020

WERBUNG ■

Wichtige Hinweise

Amundi Funds ist ein als offene Investmentgesellschaft (Société d'Investissement à Capital Variable – „SICAV“) nach den Rechtsvorschriften Luxemburgs errichteter OGAW und wird durch die Commission de Surveillance du Secteur Financier („CSSF“) reguliert. Registernummer RCS B68.806. AMUNDI FUNDS VOLATILITY EURO, ein Teilfonds von Amundi Funds, ist von der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin) für die öffentliche Vermarktung in Deutschland zugelassen. Der Herausgeber dieses Dokuments ist Amundi, 90 Boulevard Pasteur, 75730 Cedex 15 - Frankreich, in Frankreich unter der Nummer GP 04000036 registriert und durch die französische Finanzmarktaufsicht AMF zugelassen und reguliert. Dieses Dokument ist kein Prospekt. Anteile in Amundi Funds können nur auf der Grundlage des offiziellen Prospekts angeboten werden. Der aktuelle Prospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“), die Satzung, der Jahres- und der Halbjahresbericht sind kostenlos und in gedruckter Form bei der Zahl- und Informationsstelle (Marcard, Stein & Co AG, Ballindamm 36, D-20095 Hamburg, Deutschland) erhältlich und auf unserer Website www.amundi.com verfügbar. Die Dokumente sind in Deutsch. Der aktuell verfügbare Prospekt, insbesondere die Risikofaktoren, sowie das KIID sollten vor der Erwägung einer Anlage zur Kenntnis genommen werden. Die Quelle der Daten in diesem Dokument ist Amundi, sofern nichts anderes angegeben ist. Der Stand dieser Daten ist unter dem Hinweis MONATLICHES FACTSHEET oben im Dokument genannt, sofern nichts anderes angegeben ist. Hinweise: Bitte lesen Sie den Prospekt sorgfältig durch, bevor Sie eine Anlage vornehmen. Denken Sie daran, dass der Kapitalwert und der Ertrag aus Anlagen ebenso sinken wie steigen können und dass Änderungen bei Währungsumrechnungskursen einen gesonderten Effekt haben, der ebenfalls eine Ab- oder Zunahme des Werts der Anlage zur Folge haben kann. Die Wertentwicklung in der Vergangenheit lässt nicht unbedingt Rückschlüsse auf die zukünftige Wertentwicklung zu. Anleger erhalten möglicherweise nicht den ursprünglich von ihnen investierten Betrag zurück. Anleger sollten bedenken, dass hierin enthaltene Wertpapiere und Finanzinstrumente möglicherweise für ihre Anlageziele nicht geeignet sind.