QFS SICAV - Global Risk Premia EUR A dis

Multi-Asset-Produkt mit Total Return-Ansatz

Stichtag: 30. Juni 2017

Kapitalverwaltungsgesellschaft (KVG):
Union Investment Luxembourg S.A.

Bloomberg:
UQGBREA

ISIN:
LU1120175267

WKN:
A12C7K

Auflegungsdatum:
5. März 2015

Anteilsscheinwährung:
EUR

Fondsvermögen [EUR]:
151.979.469,62

Anteilspreis [EUR]:
107,62

Ertragsverwendung:
Ausschüttend

Valuta:
4 Tage (Forward Pricing)

Benchmark (BMK):

FX-Quote (inkl. Derivatewirkung) [%]
-2,27

Durchschnittliche Restlaufzeit [Jahre]:
0,07

Durchschnittliche Duration [Jahre]:
-0,33

Modifizierte Duration [%]:
-0,20

Durchschnittlicher Kupon [%]:
0,00

Durchschnittliche Rendite [%]: (vor Kosten)
8,50

Durchschnitts-Rating:
AA-

Der Fonds auf einen Blick

Das Anlagekonzept des QFS Global Risk Premia verfolgt eine Total Return Strategie mit möglichst hoher Performance, wobei die investierten Risikoprämien möglichst gering korreliert zueinander sein sollen (Multi-Beta-Ansatz). Hierzu werden sowohl long-Positionen als auch short-Positionen in verschiedenen Assetklassen eingegangen. Long- Positionen können über den Einsatz von Derivaten, bspw. durch Verwendung von Futures, Optionen und/oder Swaps, synthetisch aufgebaut werden; short-Positionen werden ausschließlich über den Einsatz von Derivaten, bspw. durch Verwendung von Futures, Optionen und/oder Swaps, synthetisch aufgebaut.

Fondsstruktur

	Anteil am Fondsvermögen [%]
Rentenorientierte Anlagen	**-12,30**
Rentenderivate	-12,30
Aktienorientierte Anlagen	**17,15**
Aktien	77,83
Aktienderivate	-64,56
Aktienfonds	3,88
Sonstige	**3,96**
Commodity Fonds	3,96
Liquidität	**12,89**

Wertentwicklung vergangener Kalenderjahre (netto) in [%] *

* gemäß BVI-Methode: Bitte beachten Sie den rechtlichen Hinweis am Ende des Berichts.

Wertentwicklung und Kennzahlen (netto) *

	1 Monat	lfd. Jahr	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	seit Auflegung
Wertentwicklung [%]	-0,29	1,73	4,24	---	---	11,02
Wertentwicklung [%] p.a.			4,24	---	---	4,61
Volatilität [%]			5,63	---	---	---
Sharpe Ratio			0,81	---	---	---

* gemäß BVI-Methode: Bitte beachten Sie den rechtlichen Hinweis am Ende des Berichts.

Union Investment

QFS SICAV - Global Risk Premia EUR A dis

Multi-Asset-Produkt mit Total Return-Ansatz

Stichtag: 30. Juni 2017

Ausschüttungen:

	je Anteil [EUR]	Rendite [%]
2016:	2,31	---
2015:	0,91	---

Geschäftsjahr:
1. Oktober - 30. September

Aktueller Ausgabeaufschlag [%]:

Aktueller Rücknahmeabschlag [%]:

Verwaltungsvergütung [% p.a.]:
0,50

Ausschüttungen [% p.a.]:
0,030% p. a., degressiv abnehmend.

Erfolgsabhängige Vergütung:
Keine

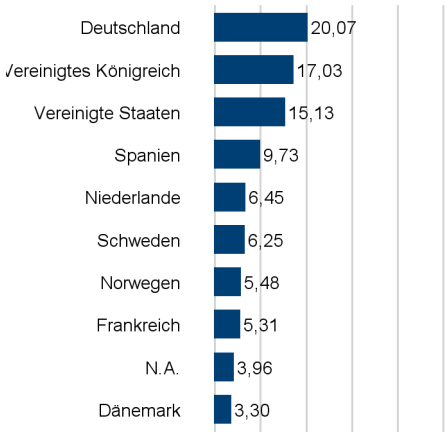
Anzahl Emittenten im Portfolio:
113

Anzahl Wertpapiere im Portfolio:
114

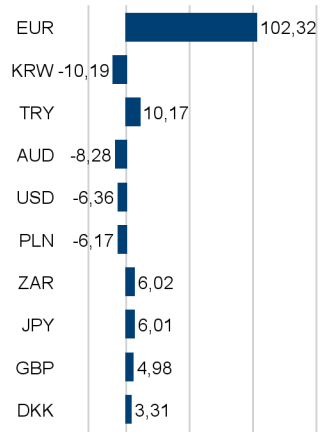
Anlageuniversum:
Globale Aktien, Renten, Währungen (überwiegend ungesichert), Commodity-ETFs sowie zugehörige Derivate

Bonitätslimite:
Keine

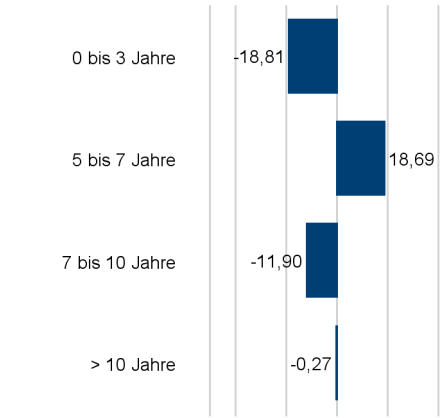
Länderallokation in % des Fondsvermögens (Top 10)



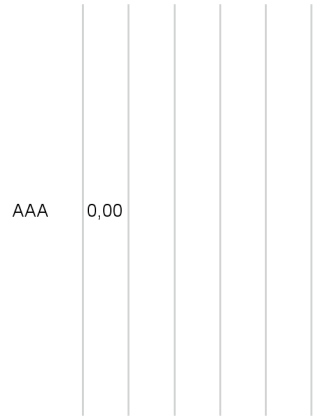
Währungsallokation in % des Fondsvermögens (Top 10)



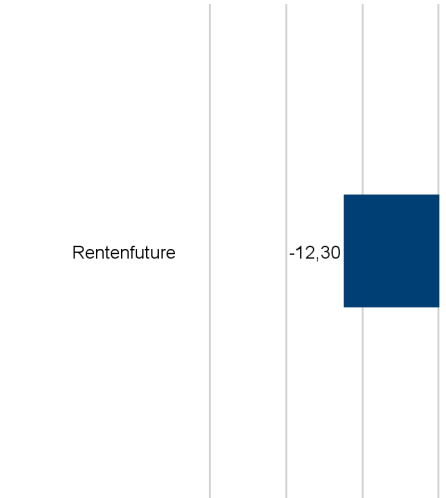
Restlaufzeitenallokation in % des Fondsvermögens



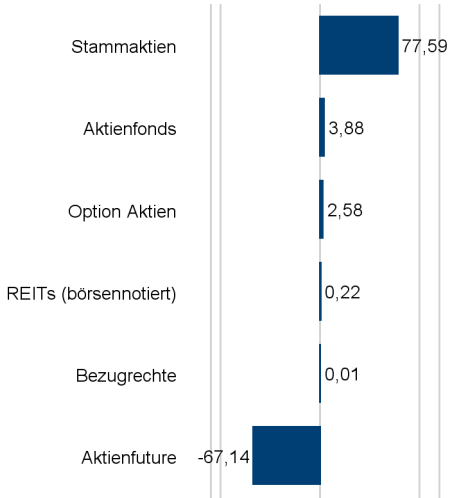
Ratingallokation in % des Fondsvermögens



Gattungsallokation Renten in % des Fondsvermögens (Top 10)



Gattungsallokation Aktien in % des Fondsvermögens (Top 10)



Union Investment

QFS SICAV - Global Risk Premia EUR A dis

Multi-Asset-Produkt mit Total Return-Ansatz

Stichtag: 30. Juni 2017

Disclaimer

Durch die Annahme dieses Dokuments akzeptieren Sie die nachstehenden Beschränkungen als für Sie verbindlich: Dieser Monatsbericht ist ausschließlich für professionelle Kunden vorgesehen. Die Inhalte dieses Dokuments wurden von Union Investment Institutional GmbH mit angemessener Sorgfalt und nach bestem Wissen zusammengestellt. Die Darstellungen und Erläuterungen beruhen auf der eigenen Einschätzung zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Dokumentes sowie auf Informationen aus eigenen oder öffentlich zugänglichen Quellen, die für zuverlässig gehalten werden. Union Investment hat die von Dritten stammenden Informationen jedoch nicht vollständig überprüft und kann daher für deren Aktualität, Richtigkeit und Vollständigkeit keinerlei Gewähr übernehmen.

Dieses Dokument dient ausschließlich Informationszwecken und ist allein zur internen Verwendung gedacht. Es darf daher weder ganz noch teilweise vervielfältigt, verändert oder zusammengefasst, an andere Personen weiterverteilt, sowie anderen Personen in sonstiger Weise zugänglich gemacht oder veröffentlicht werden. Es wird keinerlei Haftung für Nachteile, die direkt oder indirekt aus der Verteilung, der Verwendung oder Veränderung und Zusammenfassung dieses Dokuments oder seines Inhalts entstehen, übernommen. Dieses Dokument stellt keine Anlageempfehlung dar und ersetzt weder die individuelle Anlageberatung durch einen geeigneten Anlageberater, noch die Beurteilung der individuellen Verhältnisse durch einen Rechtsanwalt oder Steuerberater.

Folgendes gilt lediglich für professionelle Kunden mit Sitz in Deutschland: Soweit auf Fondsanteile oder Einzeltitel Bezug genommen wird, kann hierin eine Analyse i.S.d § 34b WpHG liegen. Sofern dieses Dokument entgegen den vorgenannten Bestimmungen einem unbestimmten Personenkreis zugänglich gemacht wird, in sonstiger Weise weiterverteilt, veröffentlicht bzw. verändert oder zusammengefasst wird, kann der Verwender dieses Dokumentes den Vorschriften des § 34b WpHG und den hierzu ergangenen besonderen Bestimmungen der Aufsichtsbehörde (insbesondere der Finanzanalyseverordnung) unterliegen.

Angaben zur Wertentwicklung von Fonds sowie die Einstufung in Risikoklassen/ Farbsystematik von Fonds und anderen Produkten von Union Investment basieren auf den Wertentwicklungen und/oder der Volatilität in der Vergangenheit. Damit wird keine Aussage über die laufende oder zukünftige Wertentwicklung getroffen.

Für qualifizierte Anleger mit Sitz in der Schweiz gilt: Die Wertentwicklungsdaten lassen bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt. Die Darstellung der Wertentwicklung entspricht den Standards der SFAMA.

Die Kennzahlen durchschnittliche Rendite, durchschnittlicher Kupon, durchschnittliche Restlaufzeit, durchschnittliche Duration, durchschnittliches Rating sowie Modified Duration werden inklusive Zielfondsauflösung unter Berücksichtigung von Kasse und Derivaten berechnet. Bei der Berechnung der durchschnittlichen Restlaufzeit werden Floater mit ihrer Endfälligkeit berücksichtigt. Das Durchschnittsrating ist eine eigene Berechnung der Union Investment (Union Comp Rating) mit Berücksichtigung von Kasse und ohne Berücksichtigung von Derivaten. Bei der Ausschüttungsrendite in % handelt es sich um die „laufende Verzinsung“ im jeweiligen Geschäftsjahr. Basis hierfür ist der Nettoinventarwert zu Beginn des betreffenden Geschäftsjahrs bereinigt um die enthaltene Ausschüttung des vorhergehenden Geschäftsjahres.

Folgendes gilt lediglich für professionelle Kunden mit Sitz in Deutschland: Der Aktiengewinn EStG gilt für natürliche Personen (Betriebsvermögen) nach § 3 Nr. 40 EStG. Der Aktiengewinn KStG gilt für Körperschaften, Personenvereinigungen oder Vermögensmassen nach § 8b Abs. 1 KStG.

Alle Allokationssichten sowie die Fondsstruktur ergeben sich aus dem zielfondsaufgelösten, wirtschaftlichen Bestand des Fonds. Absicherungspositionen durch Derivate werden verrechnet. Alle Allokationssichten werden exklusive Kasse sowie Fremd- und Immobilienfonds dargestellt. Die Zuordnung der Fondsstruktur erfolgt gemäß eigener Asset-Zuordnung der Union Investment Gruppe. Die Zuordnungen können von denen in den Jahres- und Halbjahresberichten abweichen. Die Länderallokation ergibt sich aus den Risikoländern der Assets. Die Branchenallokation ergibt sich für Aktien aus den MSCI-Branchen bzw. für Renten aus den Merrill Lynch Branchen der Assets. Die Ratingallokation erfolgt anhand einer eigenen Berechnung der Union Investment (Union Comp Rating).

Ausführliche produktspezifische Informationen und Hinweise zu Chancen und Risiken der hier genannten Fonds entnehmen Sie bitte den aktuellen Verkaufsprospekten, den Vertragsbedingungen, wesentlichen Anlegerinformationen sowie den Jahres- und Halbjahresberichten, die Sie kostenlos in deutscher Sprache über Union Investment Institutional GmbH, Weissfrauenstraße 7 in 60311 Frankfurt am Main, Tel. Nr. 069-2567-7652, erhalten. Diese Dokumente bilden die allein verbindliche Grundlage für den Kauf des Fonds. Dieses Dokument wurde von Union Investment Institutional GmbH, Frankfurt am Main, mit Sorgfalt entworfen und hergestellt, dennoch übernimmt Union Investment keine Gewähr für die Aktualität, Richtigkeit und Vollständigkeit.

Diese Dokumente bilden die allein verbindliche Grundlage für den Kauf der Fonds von Union Investment.

Quelle: Union Investment