QFS SICAV - Alternative Risk Premia EUR A dis

Globaler Risiko-Prämien Fonds

Stichtag: 31. August 2018

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

Bloomberg:
QFARPEA

ISIN:
LU1481643713

WKN:
A2AQQK

Auflegungsdatum:
4. Oktober 2016

Anteilsscheinwährung:
EUR

Fondsvermögen [EUR]:
138.802.345,40

Anteilspreis [EUR]:
93,76

Ertragsverwendung:
Ausschüttend

Valuta:
4 Tage (Forward Pricing)

Benchmark (BMK):

Fremdwährungsquote [%]
vor / nach Absicherung: 38,08 / 0,85

Durchschnittliche Restlaufzeit [Jahre]:
-1,02

Durchschnittliche Duration [Jahre]:
0,37

Modifizierte Duration [%]:
0,46

Durchschnittlicher Kupon [%]:
0,15

Durchschnittliche Rendite (brutto) [%]:
5,86

Durchschnitts-Rating:
AA

Der Fonds auf einen Blick

In Zeiten historisch niedriger Zinsen gewinnt die Erschließung neuer Ertragsquellen eine immer größere Bedeutung. Die Alternative Risk Premia-Strategie von Quoniam bietet Investments in neun voneinander unabhängige, globale Risikoprämien. Durch die gleichmäßige Verteilung der Risiken wird eine maximale Diversifikation innerhalb des Portfolios erreicht. Ergebnis: Attraktives Renditepotenzial in nahezu jeder Marktphase! Alternative Risikoprämien sind mit traditionellen Vermögensklassen (Aktien, Renten) nahezu unkorreliert und führen zu einer besseren Diversifikation im Gesamtbestand. Sie stellen daher eine ideale Ergänzung zu klassischen Portfolios dar.

Fondsstruktur

	Anteil am Fondsvermögen [%]
Rentenorientierte Anlagen	**32,53**
Renten	5,53
Rentenderivate	27,00
Aktienorientierte Anlagen	**0,71**
Aktien	80,26
Aktienderivate	-79,54
Liquidität	**14,15**

Wertentwicklung vergangener Kalenderjahre (netto) in [%] *

Fonds

* 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 [%]	-1,38	-1,14	-4,08	---	---	-4,05
Wertentwicklung [%] p.a.			-4,08	---	---	-2,15
Volatilität [%]			4,74	---	---	4,91
Sharpe Ratio			-0,79	---	---	-0,36

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

QFS SICAV - Alternative Risk Premia EUR A dis

Globaler Risiko-Prämien Fonds

Stichtag: 31. August 2018

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

Bloomberg:
QFARPEA

ISIN:
LU1481643713

WKN:
A2AQQK

Auflegungsdatum:
4. Oktober 2016

Anteilsscheinwährung:
EUR

Fondsvermögen [EUR]:
138.802.345,40

Anteilspreis [EUR]:
93,76

Ertragsverwendung:
Ausschüttend

Valuta:
4 Tage (Forward Pricing)

Benchmark (BMK):

Fremdwährungsquote [%]:
vor / nach Absicherung: 38,08 / 0,85

Durchschnittliche Restlaufzeit [Jahre]: *
-1,02

Modifizierte Duration [%]: *
0,46

Durchschnittlicher Kupon [%]: *
0,15

Durchschnittliche Rendite (brutto) [%]: *
5,86

Durchschnitts-Rating: *
AA

* Kennzahlen bezogen auf das Rentenvermögen.

Der Fonds auf einen Blick

In Zeiten historisch niedriger Zinsen gewinnt die Erschließung neuer Ertragsquellen eine immer größere Bedeutung. Die Alternative Risk Premia-Strategie von Quoniam bietet Investments in neun voneinander unabhängige, globale Risikoprämien. Durch die gleichmäßige Verteilung der Risiken wird eine maximale Diversifikation innerhalb des Portfolios erreicht. Ergebnis: Attraktives Renditepotenzial in nahezu jeder Marktphase! Alternative Risikoprämien sind mit traditionellen Vermögensklassen (Aktien, Renten) nahezu unkorreliert und führen zu einer besseren Diversifikation im Gesamtbestand. Sie stellen daher eine ideale Ergänzung zu klassischen Portfolios dar.

Fondsstruktur

	Anteil am Fondsvermögen [%]
Aktienorientierte Anlagen	0,71
Rentenorientierte Anlagen	32,53
Liquidität	14,15

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 [%]	-1,38	-1,14	-4,08	---	---	-4,05
Wertentwicklung [%] p.a.			-4,08	---	---	-2,15
Volatilität [%]			4,74	---	---	4,91
Sharpe Ratio			-0,79	---	---	-0,36

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

QFS SICAV - Alternative Risk Premia EUR A dis

Globaler Risiko-Prämien Fonds

Stichtag: 31. August 2018

Ausschüttungen:

	je Anteil [EUR]	Rendite [%]
2017:	2,20	2,20

Geschäftsjahr:
1. Oktober - 30. September

Aktueller Ausgabeaufschlag [%]:

Aktueller Rücknahmeabschlag [%]:

Verwaltungsvergütung [% p.a.]:
0,5

Pauschalvergütung [% p.a.]:
0,16

Erfolgsabhängige Vergütung:
Keine

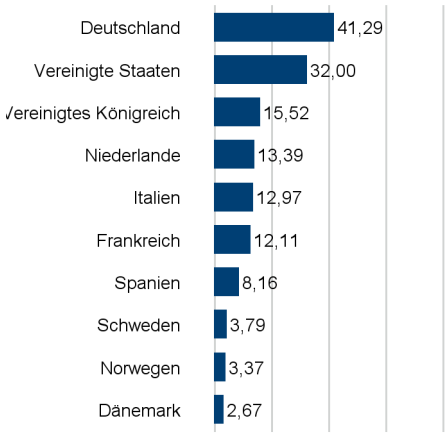
Anzahl Emittenten im Portfolio:
150

Anzahl Wertpapiere im Portfolio:
152

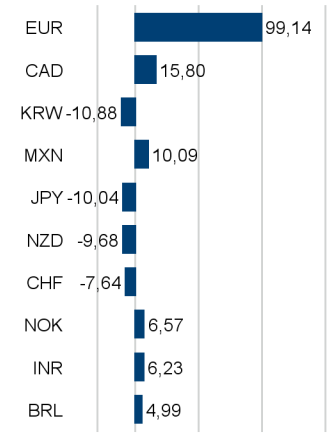
Anlageuniversum:
Globale Renten, Aktien, börsengehandelte Indexfonds (inkl. geschlossene REITS) und Derivate weltweiter Emittenten

Bonitätslimite:
keine

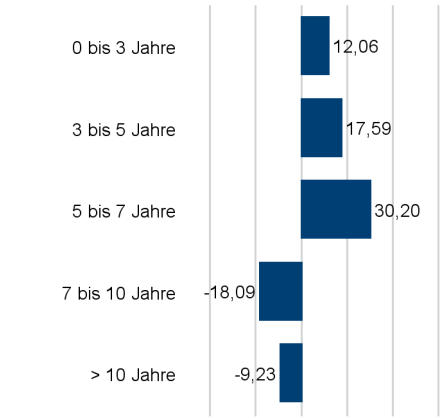
Länderallokation in % des Fondsvermögens (Top 10)



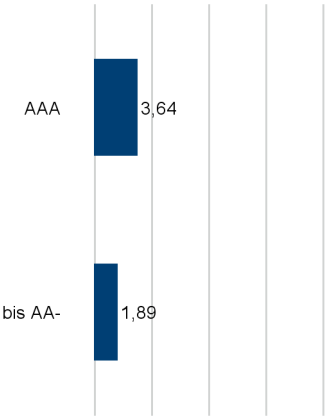
Währungsallokation in % des Fondsvermögens (Top 10)



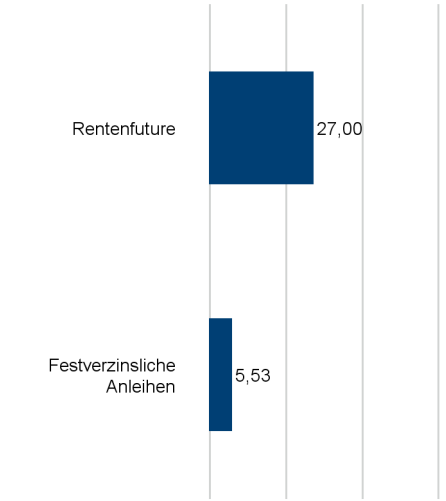
Restlaufzeitenallokation in % des Fondsvermögens



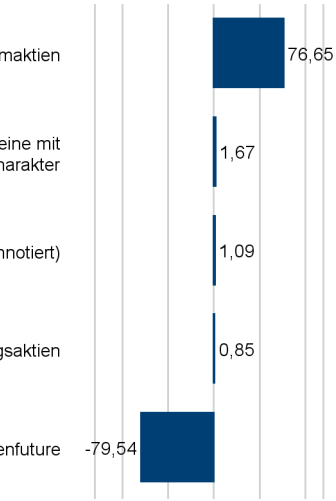
Ratingallokation in % des Fondsvermögens



Gattungsallokation Renten in % des Fondsvermögens (Top 10)



Gattungsallokation Aktien in % des Fondsvermögens (Top 10)



Union Investment

QFS SICAV - Alternative Risk Premia EUR A dis

Globaler Risiko-Prämien Fonds

Stichtag: 31. August 2018

Disclaimer

Dieses Dokument ist nicht für aufsichtsrechtliche Zwecke geeignet.

Durch die Annahme dieses Dokuments akzeptieren Sie die nachstehenden Beschränkungen als für Sie verbindlich:

Diese Anlegerinformation 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. Alle Index- bzw. Produktbezeichnungen anderer Unternehmen als Union Investment können urheber- und markenrechtlich geschützte Produkte und Marken dieser Unternehmen sein.

Dieses Dokument 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. Diese Kundeninformation 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. Soweit auf Fondsanteile oder Einzeltitel Bezug genommen wird, kann hierin eine Analyse i.S.d Art. 36 Abs. 1 Delegierte Verordnung (EU) 2017/565 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 Art. 36 Abs. 1 Delegierte Verordnung (EU) 2017/565 und den hierzu ergangenen besonderen Bestimmungen der Aufsichtsbehörde 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 eine zukünftige Wertentwicklung getroffen.

Bei der Fremdwährungsquote wird das gesamte Fondsvermögen inklusive Zielfondsauflösung und Kasse berücksichtigt. Die Kennzahlen durchschnittliche Rendite, durchschnittlicher Kupon, durchschnittliche Restlaufzeit, durchschnittliche Duration sowie Modified Duration werden inklusive Zielfondsauflösung auf Basis des Rentenvermögens und 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) auf Basis des Rentenvermögens, unter Berücksichtigung von Kasse und ohne Berücksichtigung von Derivaten. 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 Branchenallokation ergibt sich für Aktien aus den MSCI Branchen bzw. für Renten aus den Merrill Lynch Branchen der Assets. 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.

Ausführliche produktspezifische Informationen und Hinweise zu Chancen und Risiken des hier genannten Fonds von Union Investment entnehmen Sie bitte den jeweils aktuellen Verkaufsprospekten, den Anlagebedingungen sowie dem Jahres- und Halbjahresbericht, die Sie kostenlos in deutscher Sprache über Union Investment Institutional GmbH, Weißfrauenstraße 7, 60311 Frankfurt am Main, Telefon 069-2567-7652, Fax 069 2567-1616, institutional@union-investment.de, www.institutional.union-investment.de, erhalten. Diese Dokumente bilden die allein verbindliche Grundlage für den Erwerb.

Stand aller Informationen, Darstellungen und Erläuterungen: 31. August 2018, soweit nicht anders angegeben.

Quelle: Union Investment

Union Investment