

# AMUNDI FUNDS VOLATILITY EURO - A EUR

FACTSHEET

Marketing-  
Anzeige

28/02/2026

## ABSOLUTE PERFORMANCE

### Anlageziel

Erzielen einer positiven Rendite unter jeder Art von Marktbedingungen (Absolute-Return-Strategie).

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.

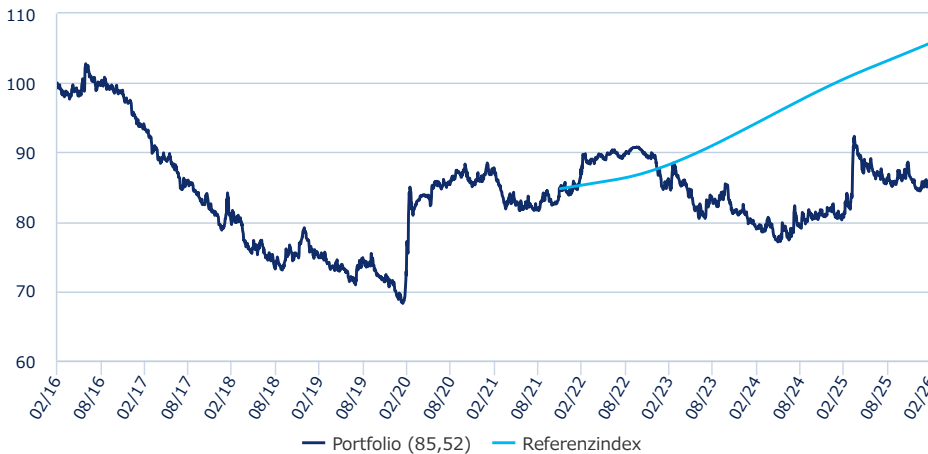
Der Teilfonds setzt in großem Umfang Derivate zur Reduzierung verschiedener Risiken, für eine effiziente Portfolioverwaltung und zum Zwecke von (Long- oder Short-) Engagements in verschiedenen Vermögenswerten, Märkten oder anderen Anlagemöglichkeiten (einschließlich Derivaten mit Schwerpunkt auf Aktien, Zinssätzen, Devisen und Dividenden) ein.

**Referenzindex:** Der Teilfonds wird aktiv verwaltet und strebt an, den Euro Short Term Rate Index (ESTER) +3 % p. a. über die empfohlene Haltedauer zu übertreffen und gleichzeitig ein kontrolliertes Risiko zu bieten. Der Teilfonds kann nachgängig einen Referenzindex als Indikator für die Beurteilung der Wertentwicklung des Teilfonds und in Bezug auf die von den entsprechenden Anteilsklassen verwendete Benchmark für die an die Wertentwicklung des Fonds gebundenen Gebühren zur Berechnung dieser Gebühren verwenden. Die Portfoliokonstruktion wird nicht durch einen Referenzindex beschränkt.

**Managementverfahren:** Der Teilfonds lässt in seinen Anlageprozess Nachhaltigkeitsfaktoren einfließen, wie ausführlich im Abschnitt „Nachhaltiges Investieren“ im Prospekt dargelegt. 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 (Quelle: Fondsadministrator) - Die frühere Wertentwicklung lässt nicht auf zukünftige Renditen schließen.

#### Performanceentwicklung (Basis: 100) \* von 29/02/2016 bis 27/02/2026 (Quelle: Fund Admin)



#### Wertentwicklung (nach Abzug von Gebühren) \* (Quelle: Fund Admin)

seit dem	seit dem	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	seit dem
	31/12/2025	30/01/2026	28/11/2025	28/02/2025	28/02/2023	26/02/2021	29/02/2016	14/11/2006
<b>Portfolio ohne Ausgabeaufschlag</b>	1,16%	0,06%	-1,19%	5,03%	-0,17%	-2,58%	-14,48%	19,97%
<b>Referenzindex</b>	0,79%	0,38%	1,24%	5,18%	19,88%	-	-	-
<b>Abweichung</b>	0,36%	-0,32%	-2,43%	-0,15%	-20,05%	-	-	-

#### Jährliche Wertentwicklung\* (Quelle: Fund Admin)

	2025	2024	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016
<b>Portfolio ohne Ausgabeaufschlag</b>	3,30%	0,27%	-8,90%	6,49%	-2,20%	20,24%	-9,07%	-2,86%	-16,89%	0,09%
<b>Referenzindex</b>	5,35%	6,98%	6,42%	3,02%	-	-	-	-	-	-
<b>Abweichung</b>	-2,05%	-6,71%	-15,32%	3,47%	-	-	-	-	-	-

\* Quelle: Fondsadministrator. Der bei Kauf anfallende einmalige Ausgabeaufschlag in Höhe von bis zu 4,50% und 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. Der Wert der Anlagen kann in Abhängigkeit von der Marktentwicklung steigen oder fallen.

#### Analyse der Renditen (Quelle: Fund Admin)

	seit Auflegung
<b>Maximaler Rückgang</b>	-40,06%
<b>Wiederaufholungsperiode (in Tagen)</b>	-
<b>Schlechtester Monat</b>	01/2023
<b>Schlechtester Monat</b>	-5,17%
<b>Bester Monat</b>	02/2020
<b>Bester Monat</b>	10,88%

#### Gleitende(r) Indikator(en) (Quelle: Fund Admin)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre
<b>Portfolio Volatilität</b>	10,40%	8,87%	7,82%	8,46%
<b>Referenzindex Volatilität</b>	0,07%	0,12%	-	-
<b>Tracking Error ex-post</b>	10,26%	8,81%	-	-
<b>Information Ratio</b>	-0,01	-0,67	-	-
<b>Sharpe Ratio</b>	0,28	-0,32	-0,30	-0,27
<b>Beta</b>	113,91	-2,81	-	-

### Wesentliche Informationen (Quelle : Amundi)

Nettoinventarwert (NAV) : (C) 119,96 ( EUR )  
(D) 104,64 ( EUR )

Datum des NAV : 27/02/2026

Fondsvolumen : 107,48 ( Millionen EUR )

ISIN-Code : (C) LU0272941971  
(D) LU0272942359

Referenzindex : 100% ESTR CAPITALISE (OIS) + 3% P.A.

#### Risiko-indikator (Quelle: Fund Admin)



Niedrigeres Risiko

Höheres Risiko

⚠ Der Risiko-Indikator beruht auf der Annahme, dass Sie das Produkt für 3 Jahre lang halten. Der Gesamtrisikoindikator hilft Ihnen, das mit diesem Produkt verbundene Risiko im Vergleich zu anderen Produkten einzuschätzen. Er zeigt, wie hoch die Wahrscheinlichkeit ist, dass Sie bei diesem Produkt Geld verlieren, weil sich die Märkte in einer bestimmten Weise entwickeln oder wir nicht in der Lage sind, Sie auszubehalten.

### Hauptmerkmale (Quelle: Amundi)

Rechtsform : **OGAW**

Auflegedatum der Anlageklasse : 13/11/2006

Voraussetzungen : **Wertpapierdepot, Lebensversicherung**

Eligible PEA : **Nein**

Ertragsverwendung : (C) **Thesaurierend**  
(D) **Ausschüttend**

Mindestanlagebetrag bei Erst-/Folgezeichnung :  
**1 Tausendstel-Anteil(e)/Aktie(n)**

Uhrzeit für den Handelsschluss :  
**Anträge pro Tag T vor 14:00**

Ausgabeaufschlag (maximal) : **4,50%**

Verwaltungsgebühren und sonstige Verwaltungs- oder Betriebskosten :  
**1,54%**

Rücknahmeabschlag (maximal) : **0,00%**

Empfohlene Mindestanlagedauer : **3 Jahre**

Erfolgsabhängige Gebühr : **Ja**

ABSOLUTE PERFORMANCE ■

\* 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. Je höher die Volatilität, desto höher das Risiko.

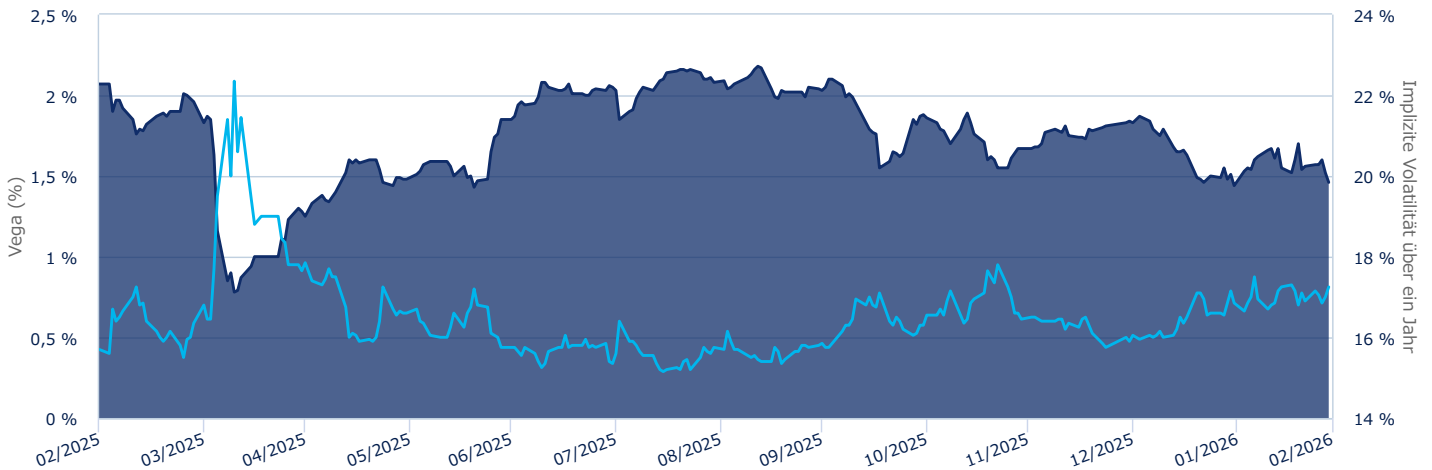


**Hassan Malongo**  
Investmentfondsverwalter



**Sofiane Ayache**  
Investmentfondsverwalter

Entwicklung der impliziten Volatilität und der Vega-Kennzahl im Jahresverlauf (Quelle: Fund Admin)



Gewichtungstabelle (Quelle: Amundi)

Implizite Volatilität über ein Jahr	Vega*
>35%	-1 mit +/-1
30%-35%	-0.5 mit +/-1
25%-30%	0 mit +/-1
20%-25%	+1 mit +/-1
15%-20%	+2 mit +/-1
<15%	+3 mit +/-1

Das Indexierungsschema dient als Hinweis. Die Portfolioverwalter verfügen über einen Handlungsspielraum von +1/-1. Das Schema kann je nach Marktsituation angepasst werden.

\* Vega: Sensitivitätskennzahl eines Fonds für die Änderung der impliziten Volatilität um 1%

## ABSOLUTE PERFORMANCE ■

## Beitrag zur Leistung (Quelle: Fund Admin)

Wertentwicklungen	Implizite Volatilität			Beitrag zur Brutto-Performance	
	Beginn	Ende	Durchsch. nittliches	Motor 1 : Direktional 1 <sup>1</sup>	Motor 2 : Vol. der Vol. 2 <sup>2</sup>
YTD 2026					
Februar 2026					
Jänner 2026					
Dezember 2025					
2025					
2024					
2023					
2022					
2021					
2020					
2019					
2018					
YTD 2025	16,05%	17,25%	1,61%	1,93%	-0,54%
Feb-2026	16,85%	17,25%	1,58%	0,63%	-0,46%
Jan-2026	16,05%	16,85%	1,64%	1,31%	-0,09%
Dec-2025	16,45%	16,05%	1,76%	-0,70%	-1,48%
2024	15,75%	15,80%	1,95%	0,10%	1,68%
2023	20,60%	15,75%	1,51%	-7,32%	-0,23%
2022	18,00%	20,60%	0,64%	1,66%	7,28%
2021	18,60%	18,00%	1,33%	-0,80%	0,29%
2020	14,20%	18,60%	0,95%	4,18%	23,20%
2019	17,70%	14,20%	2,10%	-7,35%	-1,05%
2018	15,25%	17,70%	2,12%	5,19%	-5,72%
2017	19,80%	15,25%	1,62%	-7,37%	-8,24%
2016	21,00%	19,80%	0,92%	-1,10%	2,79%
2015	20,30%	21,00%	0,99%	2,04%	2,06%
2014	17,50%	20,30%	1,35%	3,83%	-3,03%
2013	21,70%	17,50%	1,09%	-4,31%	-5,36%
2012	28,05%	21,70%	0,61%	-1,72%	1,01%
2011	24,05%	28,05%	0,35%	-3,67%	7,80%
2010	24,30%	24,05%	0,46%	1,76%	7,17%
2009	34,80%	24,30%	-0,13%	1,13%	6,07%
2008	20,30%	34,80%	0,50%	5,70%	18,54%

<sup>1</sup> Direktional 1: monatlich wie folgt berechnet: (Ende implizierte Volatilität – Beginn implizierte Volatilität) \* durchschnittliches Vega

<sup>2</sup> Vol. der Vol. 2: monatlich wie folgt berechnet: Bruttorendite – Andere Motoren. Replikations- und Carry-Kosten enthalten.

## Wichtige Hinweise

Dieses Dokument enthält Angaben zum Teilfonds „AMUNDI FUNDS VOLATILITY EURO“, einem Teilfonds der Kapitalanlagegesellschaft Amundi Funds, einem Unternehmen für kollektive Kapitalanlagen in übertragbaren Wertpapieren gemäß Teil I des luxemburgischen Gesetzes vom 17. Dezember 2010, das als „société d'investissement à capital variable“ (SICAV) betrieben wird und im luxemburgischen Handelsregister unter der Nummer B68.806 eingetragen ist. Die SICAV betreibt eine zugelassene Geschäftsstelle in 5, Allée Scheffer, L-2520 Luxemburg. Der Teilfonds wurde von der „Finanzmarktüberwachungskommission“ in Luxemburg zum öffentlichen Verkauf zugelassen und zum Vertrieb für nicht qualifizierte Anleger in oder aus der Schweiz von der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht („FINMA“) zugelassen. Zum Investmentfonds gehören weitere Teilfonds, die im ausführlichen Fonds-Verkaufsprospekt und im wesentliche Anlegerinformationen (KIID), beschrieben sind. Nicht alle Teilfonds sind zwangsläufig für den Verkauf in allen Rechtssystemen registriert bzw. zugelassen oder für alle Anleger verfügbar. Für Anlageorders für den Teilfonds sind nur die neuesten ausführlichen Fonds-Prospekte und wesentliche Anlegerinformationen (KIID) sowie die neuesten Jahres- und Halbjahresberichte und entsprechende Nachträge maßgeblich, die kostenfrei bei der zugelassenen SICAV-Geschäftsstelle oder bei CACEIS (Switzerland) S.A., route de Signy 35, CH-1260 Nyon, Schweiz, der Vertretung des Investmentfonds in der Schweiz gemäß Schweizer Bundesgesetz über die kollektiven Kapitalanlagen vom 23. Juni 2006 („LPCC“) angefordert werden können. Als Zahlstelle in der Schweiz fungiert ab dem 1. Januar 2017 vorbehaltlich der Genehmigung durch die FINMA CACEIS Bank, Paris, Geschäftsstelle Nyon / Schweiz, 35 route de Signy, 1260 Nyon, Schweiz (vormals „CACEIS Bank Luxembourg, Luxemburg, Geschäftsstelle Nyon“). Anlageorders für den Teilfonds nimmt jede Vertriebsstelle oder die Investmentgesellschaft selbst bis zu dem im Prospekt angegebenen Börsenschluss direkt entgegen. Es sollte darauf geachtet werden, ob die mit einer Anlage in den Teilfonds verbundenen Risiken für den Anlageinteressenten geeignet sind; dieser sollte darauf achten, dass er den Inhalt dieses Dokuments voll und ganz verstanden hat. Bei Unklarheiten sollten Sie sich von einem Fachberater beraten lassen, ob eine Anlage in dem Teilfonds überhaupt sinnvoll ist. Der Wert einer Anlage im Teilfonds und die dazugehörigen Erträge können steigen und sinken. Der Teilfonds hat keine garantierte Rendite. Außerdem bieten frühere Wertentwicklungen keine Gewähr oder verlässliche Hinweise für künftige Erträge. Bei den Performance-Angaben sind Provisionen, Gebühren und Kosten, die bei der Ausgabe und Rücknahme von Fondsanteilen anfallen, nicht berücksichtigt. Dieses Dokument bildet kein Kaufangebot noch eine Aufforderung zum Verkauf in Ländern, in denen dies gesetzlich nicht zulässig ist; es ist auch nicht als öffentliche Werbung oder Anlageberatung zu verstehen. Amundi Suisse SA ist als Vertriebsträger von kollektiven Kapitalanlagen bewilligt. Amundi Suisse SA vertreibt in der Schweiz und aus der Schweiz kollektive Kapitalanlagen, die von Amundi Asset Management und/oder Amundi Luxembourg SA verwaltet werden. Zu diesem Zweck informiert Amundi Suisse SA hiermit die Anleger, dass sie von Amundi Asset Management und/oder Amundi Luxembourg SA Kommissionen nach Art. 34 Abs. 2bis der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (Kollektivanlagenverordnung, KKV) erhält. Die Kommission kann einen Teil der Verwaltungsgebühr, bezeichnet im Verkaufsprospekt, darstellen. Zusätzliche Informationen im Hinblick auf die Existenz, die Natur und die Berechnungsmethode der Kommissionen können von Amundi Suisse SA im Rahmen der Vertriebstätigkeit in der Schweiz oder aus der Schweiz auf schriftliche Anfrage erhalten werden bei Amundi Suisse SA 6-8 rue de Candolle 1205 Genève Suisse. Ohnehin dürfen Personen, die Beschränkungen unterliegen, wie US-Bürger, keinen Zugang zu den darin enthaltenen Informationen erhalten. Daten werden von Amundi zur Verfügung gestellt und datiert wie unter der Überschrift „MONATSBERICHT“ auf der ersten Seite erwähnt, sofern nichts anderes angegeben ist. Amundi Asset Management, eine französische Aktiengesellschaft („Société Anonyme“) ist von der französischen Finanzaufsicht (Autorité des Marchés Financiers/AMF) unter der Nummer GP 04000036 als Vermögensverwaltungsgesellschaft, 91-93 boulevard Pasteur - 75015 Paris - Frankreich - Handelsregister 437 574 452 RCS Paris zugelassen.