

iShares Edge MSCI Europe Minimum Volatility

Stand: 13.01.2025

Stammdaten

ISIN	IE00B86MWN23
Enthaltene Positionen	ca. 160
Fondsgesellschaft	BlackRock Asset Management Ireland Limited
Fondsdomizil	Irland
Fondswährung	EUR
Aufledgedatum	30.11.2012
Fondsvermögen	781,98 Mio.
Laufende Kosten	0,25 %
Performance Fee	keine
Scope Rating	(C)
Scope ESG Rating	n.v.

Fondskennzahlen

Rendite 3 Monate	-1,24 %
Rendite 6 Monate	2,65 %
Rendite 1 Jahr p.a.	10,45 %
Rendite 3 Jahre p.a.	3,84 %
Rendite 5 Jahre p.a.	4,73 %
Rendite lfd. Jahr	0,95 %
Wertentwicklung 2024	11,25 %
Wertentwicklung 2023	11,50 %

Risikokennzahlen

Volatilität 3 Jahre	11,03 %
Sharpe Ratio 3 Jahre	0.14
Max. Verlust in Monaten	3
Max. Drawdown 3 Jahre	-16,95 %

Risikoindikator (SRI)

1 2 3 **4** 5 6 7

Top Positionen

SAP	1,59 %
Deutsche Telekom	1,54 %
Zurich Insurance Group	1,53 %
Unilever PLC	1,50 %
RELX Plc	1,50 %
Iberdrola, S.A.	1,49 %
Sanofi	1,48 %
Wolters Kluwer	1,47 %
Swisscom AG Reg.	1,45 %
Koninklijke Ahold Delhaize	1,45 %
Summe Top-Positionen	15,00 %

Anlageschwerpunkt

Die Anteilklasse ist eine Anteilklasse eines Fonds, der durch eine Kombination aus Kapitalwachstum und Erträgen auf das Fondsvermögen die Erzielung einer Rendite aus Ihrer Anlage anstrebt, welche die Rendite des MSCI Europe Minimum Volatility Index, des Referenzindex des Fonds (Index), widerspiegelt. Die Anteilklasse wird über den Fonds passiv verwaltet und investiert, soweit dies möglich und machbar ist, in die Eigenkapitalinstrumente (z. B. Aktien), aus denen sich der Index zusammensetzt. Der Index strebt eine Abbildung der Performance-Eigenschaften eines Segments der Wertpapiere im MSCI Europe Index (Parent-Index) mit der niedrigsten absoluten Renditevolatilität an, vorbehaltlich einer Risikosteuerung. Die Indexwerte werden unter Verwendung einer Mindestvolatilitätsstrategie ausgewählt, die Wertpapiere aus dem Parent-Index auf der Grundlage von Schätzungen des Risikoprofils und der erwarteten Volatilität jedes Indexwerts sowie der Korrelation zwischen allen Indexwerten im Parent-Index auswählt. Die Volatilität der Renditen misst die Bewegungen des Tagespreises der Indexwerte über einen bestimmten Zeitraum. Der Parent-Index misst die Wertentwicklung von Unternehmen mit hoher und mittlerer Markt kapitalisierung in Aktienmärkten von Industrieländern in Europa. Die Mar...

Wertentwicklung



Vermögensaufteilung



Regionen

Vereinigtes Königrei...	17,83 %
Schweiz	17,04 %
Deutschland	13,15 %
Frankreich	12,09 %
Spanien	8,25 %
Niederlande	7,48 %
Italien	6,77 %
Finnland	4,51 %
Belgien	4,11 %
Dänemark	3,43 %

Sektorengewichtung

Gesundheitsversorgun...	17,65 %
Finanzwesen	16,14 %
nichtzyklische Konsum...	15,34 %
Industrie	12,58 %
Versorger	8,95 %
Kommunikation	8,93 %
Energie	5,51 %
zyklische Konsumgüter...	5,12 %
Materialien	5,11 %
IT	2,68 %