



P.A.M. Prometheus Asset Management GmbH

www.alphatrend-fund.de

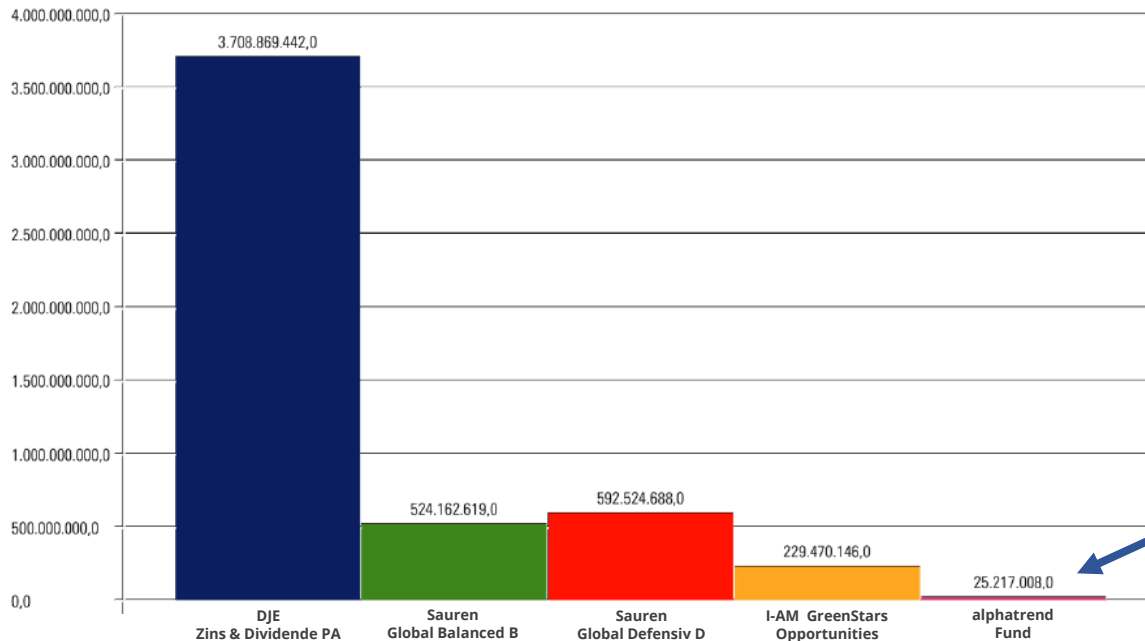


DER ALL-WETTER-FONDS | REGELBASIERT. SYSTEMATISCH. DIVERSIFIZIERT.

Herzlich Willkommen zum Speed-Dating.

Fund Size

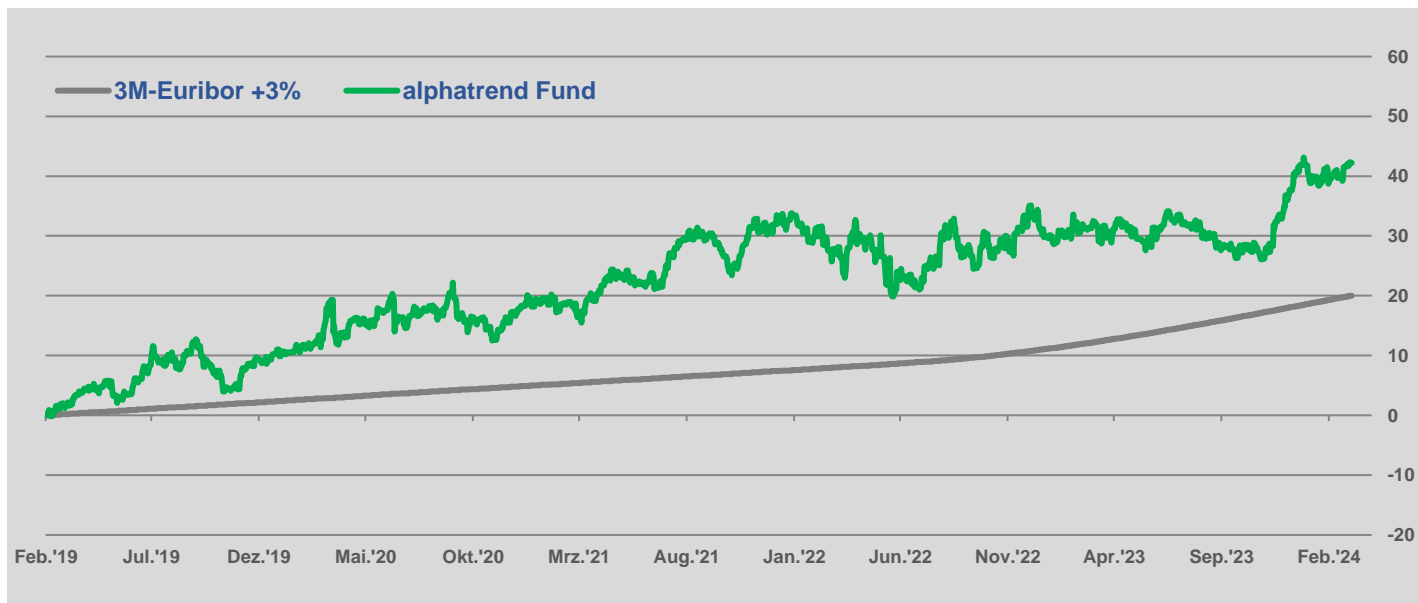
Currency: Euro



Der Ungeliebte?

***„Mein Sohn, das Aussehen weckt die Liebe,
der Charakter erhält sie.“***

WERTENTWICKLUNG | 1. Februar 2019 – 04. März 2024



Rendite:
7,17% p.a.

Maximum Drawdown:
-10,40%

Ergebnisse der Anteilsklasse R
für private Investoren.

Die Ergebnisse der Anfang 2022
aufgelegten Anteilsklasse I
für institutionelle Investoren
fallen aufgrund geringerer Fondskosten
um 0,67% p.a. höher aus.

JAHRESERGEBNISSE

2019 +11,31% p.a. | 2020 +8,53% | 2021 +11,81% | 2022 -2,46% | 2023 +8,99% | 2024 +0,34%

Alphatrend Fund | Anlageziel

Der **alphatrend Fund** verfolgt das Ziel, unabhängig von den Entwicklungen an den Kapitalmärkten hohe positive Erträge in Euro zu erwirtschaften. Dabei strebt der Fonds eine **Zielrendite** an, die mit der langfristigen Rendite von Aktien vergleichbar ist (**6-8% p.a.**) – bei gegenüber Aktien gleichzeitig **deutlich reduzierten Kursschwankungen**.

Der weltweite anlegende All-Wetter-Fonds investiert sowohl in die internationalen **Aktienmärkte** (Einzelaktien, Futures) als auch in die internationalen **Rentenmärkte** (Futures).

Im Rahmen des Fonds basieren alle Anlageentscheidungen ausschließlich auf eigenentwickelten, rein **regelbasierten** und **systematischen Handelsalgorithmen**.



MONATSBERICHT FEBRUAR 2024

www.alphatrend-fund.de

Fondsstrategie

Der **alphatrend Fund** verfolgt das Ziel, unabhängig von den Entwicklungen an den Kapitalmärkten hohe positive Erträge in Euro zu erwirtschaften. Dabei strebt der offensiv ausgerichtete, breit diversifizierte und weltweit anlegende **Absolute Return** - Fonds gegenüber Aktien deutlich reduzierte Kursschwankungen an.

Um dieses Ziel zu erreichen, kommen im Fonds zwei voneinander unabhängige, rein regelbasierte Basis-Strategien (GALAXY, HEDGE+) zum Einsatz, die ihrerseits über jeweils drei Substrategien verfügen (Breakout, Contrarian und Swing). Während im Rahmen der Basis-Strategie GALAXY nach einer LONG-FLAT-Systematik kurzfristig orientierte Positionen in Einzelaktien (Haltedauer i.d.R. 5-12 Tage) eingegangen werden, verfolgt HEDGE+ eine – ebenfalls kurzfristig orientierte – LONG/SHORT-Systematik bei internationalen Aktien- und Rentenindizes (Haltedauer i.d.R. 8-16 Tage).

Aufgrund seiner breiten Streuung eignet sich der **alphatrend Fund** als Basisinvestment für renditeorientierte Anleger. Darüber hinaus ist er aufgrund seiner geringen Korrelation zu Aktienfonds als Teilersatz oder Ergänzung für diese zur Diversifikation des offensiven Portfolianteils geeignet.

WKN / ISIN
AZ2DW9 / LU1687250271

Kapitalverwaltungsgesellschaft
LRI Invest S.A.

Fondsberatung
P.A.M. Prometheus Asset Management GmbH

Depotbank
European Depository Bank SA, Luxembourg

Wirtschaftsprüfer
KPMG Luxembourg

Ausgabeaufschlag
bis zu 5%

Verwaltungvergütung
bis zu 0,14% p.a.

Anlageberatervergütung
bis zu 1,07% p.a.

Vertriebsstellenvergütung
bis zu 0,60% p.a.

Verwalterstellenvergütung
bis zu 0,04% p.a.

Erfolghonorar
15% des Mehrertrags ggü. 3M-Euribor + 3% (inkl. High Watermark)

Erstausgabepreis
100 EUR am 23.04.2018

Geschäftsjahr
1. Mai bis 30. April

Gewinnverwendung
Ausschüttend

Mindestanlage / Sparpläne
Keine / Der Fonds ist sparrplanfähig.

Mindestaktienquote
Keine

Fondsvolumen
25,12 Mio. Euro

Wertentwicklung | Chart



Wertentwicklung seit vollständiger Integration identischer Teil-Strategien im Fonds am 04.02.2019.

Portfolioaufteilung

Allokation nach Anlageklassen	Strategie und Methodik	Trendzyklus / Investitionsdauer
US-Einzelaktien 50%	GALAXY BREAKOUT CONTRARIAN SWING	Long / Flat Long / Flat Long / Flat
Aktien-Indizes 25%	HEDGE+ BREAKOUT CONTRARIAN SWING	Long / Short Long / Short Long / Short
Renten-Indizes 25%	HEDGE+ BREAKOUT CONTRARIAN SWING	Long / Short Long / Short Long / Short



100%

STANDORTBESTIMMUNG

26.02.2024

Scope-Analyse: Das sind die stärksten Mischfonds

Die Agentur Scope hat aus mehr als 1700 weltweit anlegenden Mischfonds die 38 besten Produkte ermittelt. Unter den Top-Fonds der vier Kategorien dynamisch, ausgewogen, konservativ und flexibel finden sich Dickschiffe – aber auch weniger bekannte Vehikel.



Tabelle 1: Mischfonds global dynamisch **6 Fonds**

Fonds	ISIN	Volumen (Mio. €)	Lfd. Kosten (p.a.)	Rendite 5 J. (p.a.)	Volatilität 5 J. (p.a.)
Allianz Dynamic MultiAsset Strg SRI75 A (EUR)	LU1089088311	1032,62	1,77%	9,84%	12,38%
Allianz Strategiefonds Wachstum - A - EUR	DE0009797266	553,49	1,60%	7,95%	12,69%
BRW Balanced Return Plus V	DE000A1110J4	1266,51	1,31%	9,08%	11,37%

Tabelle 2: Mischfonds global ausgewogen **11 Fonds**

Fonds	ISIN	Volumen (Mio. €)	Lfd. Kosten (p.a.)	Rendite 5 J. (p.a.)	Volatilität 5 J. (p.a.)
Allianz Dynamic MultiAsset Strg SRI50 AT-EUR	LU1093406186	2024,15	1,76%	5,81%	9,23%
Allianz Strategiefonds Balance - A - EUR	DE0009797258	967,71	1,44%	4,83%	9,43%
Baloise FI (Lux) - BFI Progress (EUR) R	LU0127031556	149,5	1,59%	4,27%	10,38%

Tabelle 3: Mischfonds global konservativ **11 Fonds**

Fonds	ISIN	Volumen (Mio. €)	Lfd. Kosten (p.a.)	Rendite 5 J. (p.a.)	Volatilität 5 J. (p.a.)
Allianz Dynamic MultiAsset Strg SRI15 AT-EUR	LU1548496022	1618,94	1,24%	1,83%	5,55%
Amundi Ethik Fonds A	AT0000857164	1426,72	1,08%	2,00%	6,63%
DPAM B Defensive Strategy B	BE6227492921	125,28	1,13%	2,22%	6,84%

Tabelle 4: Mischfonds global flexibel **10 Fonds**

Fonds	ISIN	Volumen (Mio. €)	Lfd. Kosten (p.a.)	Rendite 5 J. (p.a.)	Volatilität 5 J. (p.a.)
Amundi Ethik Fonds Evolution A	AT0000774484	627,54	1,60%	7,50%	9,38%
Bethmann Vermögensverwaltung Ausgewogen	LU0328069454	216,27	1,23%	4,97%	9,75%
DWS Balance	DE0008474198	272,34	1,32%	4,35%	8,96%

STANDORTBESTIMMUNG | SCOPE-ANALYSE: *Mischfonds global dynamisch*

Wertentwicklung

Time Period: 05.03.2019 to 04.03.2024

Currency: Euro Source Data: Total Return

über 5 Jahre



— alphatrend Fund	39,2%	— Allianz Dyn MITAst Stgy SRI75 A EUR	55,8%	— Allianz Strategiefonds Wachstum A EUR	45,0%
— BRW Balanced Return Plus V	49,8%	— Dimensional World Allc 80/20 EUR Acc	44,0%	— Plusfonds A EUR	55,3%
— DWS Strategic ESG Allocation Dyn LC	41,7%				

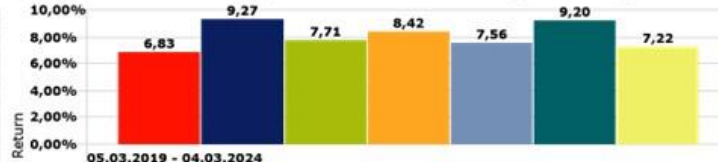
Maximaler Verlust

Currency: Euro Source Data: Total, Daily Return



Rendite in % p.a.

Currency: Euro Source Data: Total, Daily Return Calculation Benchmark: Morningstar EU Mod Gbl Tgt Alloc NR EUR



STANDORTBESTIMMUNG | SCOPE-ANALYSE: *Mischfonds global ausgewogen*

Wertentwicklung

Time Period: 05.03.2019 to 04.03.2024

Currency: Euro Source Data: Total Return

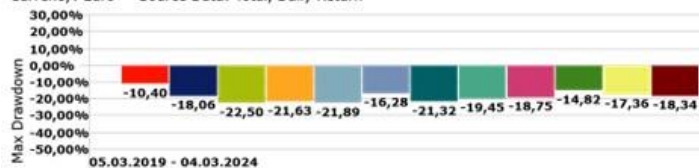
über 5 Jahre



— alphatrend Fund	39,2%	— Allianz Dyn MitAst Stgy SRI50 AT EUR	29,9%	— BFI (Lux) Progress EUR R	18,3%
— Allianz Strategiefonds Balance A EUR	25,3%	— BGF Global Allocation A2	41,5%	— BRW Balanced Return V	17,0%
— ODDO BHF Exklusiv:PolarisBalDRW-EUR	25,2%	— DC Value Global Balanced PT	58,4%	— Gothaer Comfort Balance T	23,4%
— Franklin Diversified Bal A(acc)EUR	20,0%	— Siemens Balanced	19,9%	— Schoellerbank Global Pension Fds A	17,2%

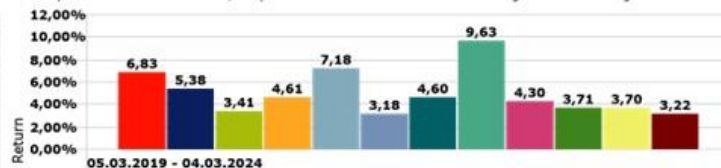
Maximaler Verlust

Currency: Euro Source Data: Total, Daily Return



Rendite in % p.a.

Currency: Euro Source Data: Total, Daily Return Calculation Benchmark: Morningstar EU Mod Gbl Tgt Alloc NR EUR



STANDORTBESTIMMUNG | SCOPE-ANALYSE: *Mischfonds global konservativ*

Wertentwicklung

Time Period: 05.03.2019 to 04.03.2024

Currency: Euro Source Data: Total Return

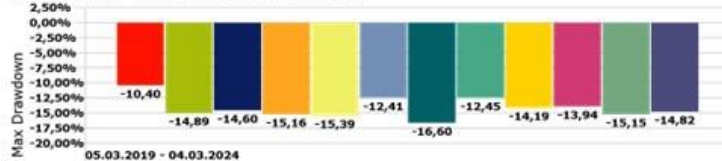
über 5 Jahre



— alphatrend Fund	39,2%	— Amundi Ethik Fonds A	7,5%	— Allianz Dyn MitAst Stgy SRI15 AT EUR	8,3%
— DPAM B Defensive Strategy B	8,4%	— DWS Strategic ESG Allocation Defesv LC	8,7%	— FvS - Multi Asset - Defensive RT	7,7%
— FOS Rendite und Nachhaltigkeit A	11,4%	— ODDO BHF Polaris Moderate DRW EUR	14,0%	— Pictet-Multi Asset Global Opps P EUR	8,8%
— Weberbank Premium 30	6,9%	— YOU INVEST GREEN balanced T	8,1%	— YOU INVEST GREEN Portfolio 30 EUR R01 T	8,8%

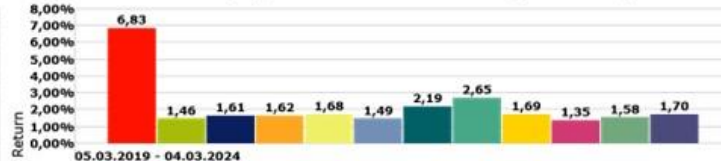
Maximaler Verlust

Currency: Euro Source Data: Total, Daily Return



Rendite in % p.a.

Currency: Euro Source Data: Total, Daily Return Calculation Benchmark: Morningstar EU Mod Gbl Tgt Alloc NR EUR



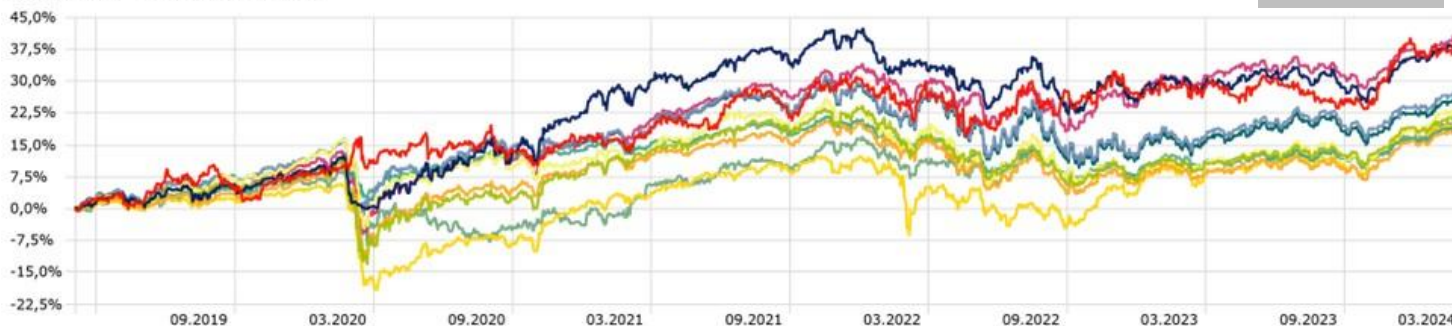
STANDORTBESTIMMUNG | SCOPE-ANALYSE: *Mischfonds global flexibel*

Wertentwicklung

Time Period: 05.03.2019 to 04.03.2024

Currency: Euro Source Data: Total Return

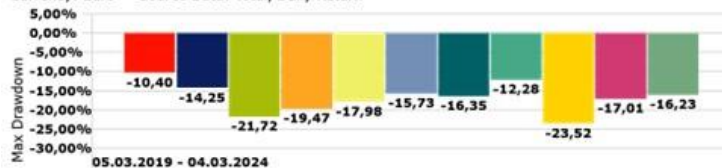
über 5 Jahre



alphatrend Fund	39,2%	Amundi Ethik Fonds Evolution A	40,2%	Bethmann Vermögensverwaltung Ausgewogen	22,3%
DWS ESG Balance	18,9%	FvS - Multi Asset - Growth RT	23,5%	FvS SICAV Multiple Opportunities R	27,7%
FvS Multiple Opportunities II RT	26,2%	FVM-Classik I	20,0%	Generali Global Multi Asset Inc DX Acc	20,7%
RW Portfolio Strategie UI	41,1%	T3 Global Allocation A (a)	21,0%		

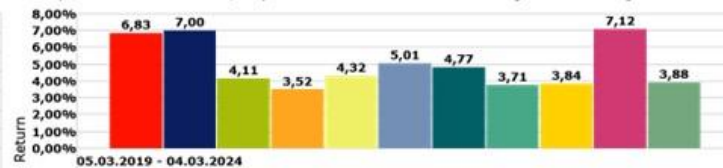
Maximaler Verlust

Currency: Euro Source Data: Total, Daily Return



Rendite in % p.a.

Currency: Euro Source Data: Total, Daily Return Calculation Benchmark: Morningstar EU Mod Gbl Tgt Alloc NR EUR



STANDORTBESTIMMUNG | CHANCE/RISIKO-VERHÄLTNIS

● Calmar Ratio (= Rendite in % p.a. / Maximaler Verlust)

RANG	FONDS	Calmar Ratio
1.	alphatrend Fund	0,66
2.	DC Value Global Balanced	0,50
3.	Amundi Ethik Fonds Evolution	0,49
4.	RW Portfolio Strategie UI	0,42
5.	BRW Balanced Return Plus 5	0,40
6.	Allianz Dynamic MultiAsset Strategy SRI75	0,38
7.	Plusfonds A	0,38
8.	BGF Global Allocation	0,33
9.	Flossbach von Storch - Multiple Opportunities R	0,32
10.	FVM Classic - AK I	0,30
11.	Allianz Dynamic MultiAsset Strategy SRI50	0,30
12.	Flossbach von Storch - Multiple Opportunities II RT	0,29
13.	Allianz Strategiefonds Wachstum	0,27
14.	DWS Strategic ESG Allocation Dynamic	0,26
15.	Franklin Diversified Balanced	0,25
16.	Dimensional World Allocation 80/20	0,24
17.	T3 Global Allocation A	0,24
18.	Gothaer Comfort Balance T	0,23
19.	ODDO BHF Exklusiv: Polaris Balanced	0,22
20.	Allianz Strategiefonds Balance	0,21

RANG	FONDS	Calmar Ratio
21.	Siemens Balanced	0,21
22.	ODDO BHF Exklusiv: Polaris Moderate DRW	0,21
23.	BRW Balanced Return V	0,20
24.	Bethmann Vermögensverwaltung Ausgewogen	0,19
25.	Flossbach von Storch - Multi Asset - Growth	0,18
26.	DWS ESG Balance	0,18
27.	Schoellerbank Global Pension Fonds	0,18
28.	Generali IS - Global Multi Asset Income DX	0,16
29.	Baloise FI(Lux) - BFI Progress R	0,15
30.	FOS Rendite und Nachhaltigkeit A	0,13
31.	Flossbach von Storch - Multi Asset - Defensive	0,12
32.	Pictet - Multi Asset Global Opportunities	0,12
33.	YOU INVEST GREEN Portfolio 30	0,11
34.	Allianz Dynamic MultiAsset Strategy SRI15	0,11
35.	DWS Strategic ESG Allocation Defensive	0,11
36.	DPAM B Defensive Strategy	0,11
37.	YOU INVEST GRREN balanced T	0,10
38.	Amundi Ethik Fonds A	0,10
39.	Weberbank Premium 30	0,10

***Und nun...
doch noch ein bisschen über seinen Charakter.***

CHARAKTER

Äußerst ungeduldig (= aktiv)

Haltedauer der Positionen i.d.R. lediglich wenige Tage.

Im Durchschnitt 2.000 Transaktionen mit Einzelaktien und 1.600 Transaktionen mit Futures pro Jahr.

und sehr flatterhaft (= hochflexibel)

Investitionsquoten und LONG / SHORT-Positionierungen verändern sich täglich.

aber diszipliniert (= emotionslos)

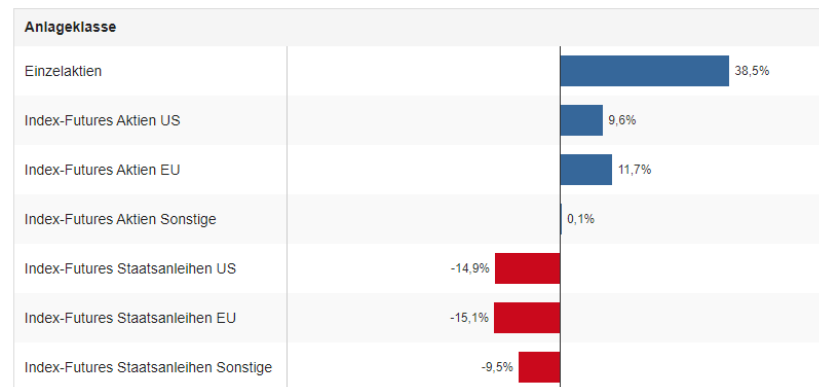
100% regelbasiert und systematisch.

rücksichtsvoll (= kapitalerhaltend)

Risikomanagement lässt Anleger ruhig schlafen.

und ehrlich (= transparent)

Tägliche Veröffentlichung der Portfolio-Positionierung.



FONDSSTRATEGIE | 2 Herzen in einer Brust.

HANDESSYSTEM 1



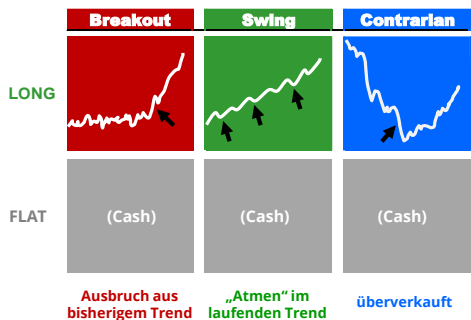
GALAXY | 50%

Hochliquide, internationale Einzelaktien
Internationale Aktienindex-Futures

Haltedauer der Positionen: Ø 5-12 Tage

Time in market: Ø 53%

Transaktionen pro Jahr: Ø 2.000



HANDESSYSTEM 2



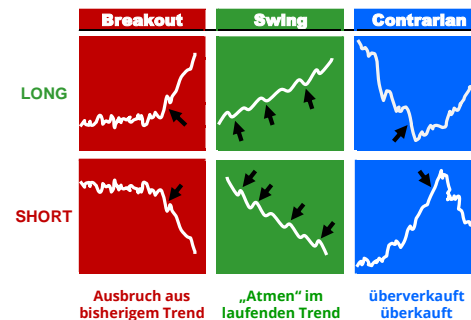
HEDGE+ | 50%

Internationale Aktienindex-Futures
Internationale Rentenindex-Futures

Haltedauer der Positionen: Ø 8-16 Tage

Time in market: 100%

Transaktionen pro Jahr: Ø 1.600



ANLAGEUNIVERSUM

Hochliquide Einzelaktien | mit dynamischer Währungsabsicherung

Abbott Labs, AbbVie, Accenture, Adobe Systems, AMD, Alphabet, Amazon, American Express, Amgen, Apple, ASML Holdings, AT&T, Avago / Broadcom, Bank of America, Berkshire Hathaway, Blackrock, Caterpillar, Chevron, Cisco, Coca Cola, Comcast, Conoco Phillips, Costco Wholesale, Danaher, Eli Lilly, ExxonMobil, General Electric, Goldman Sachs, Home Depot, IBM Corp, Intel, Intuit, JP Morgan, Johnson & Johnson, Linde, Lowe's Co, Master Card, McDonald's, Merck, Meta Platforms, Microsoft, Morgan Stanley, Netflix, NextEra Energy, Nike, Nvidia, Oracle, Pepsico, Pfizer, Procter & Gamble, Prologis, Qualcomm, S&P Global, Salesforce, SAP AG ADS, Service Now, Starbucks, Tesla, Texas Instruments, Thermo Fisher Scientific, TJX, Uber, Union Pacific, United Health, United Parcel Service, Verizon, Visa, Walmart, Walt Disney, Wells Fargo

Internationale Aktienmärkte | Index-Futures

DAX, EuroStoxx 50, Stoxx Europe 600, SMI, FTSE100, Dow Jones, S&P 500, S&P MidCap, Nasdaq, Russell, Nikkei, CBOE VIX Future

Internationale Rentenmärkte | Index-Futures

Deutschland EuroBOBL, Deutschland EuroBUND, Deutschland Euro BUXL, Frankreich Euro-OAT, Italien Euro-BTP, UK Gilt, US 2 Year Treasury, US 5 Year Treasury, US 10 Year Treasury, US 30 Year Treasury, US Ultra Bond



FAZIT

~~ALLES~~KÖNNER

Damit Sie nicht auf dumme Gedanken kommen.



Sollen sich doch andere über schlechte Kurse aufregen!



www.alphetrend-fund.de

Der All-Wetter-Fonds für Ihr Portfolio

WKN A2DXW9 | Anteilsklasse für private Investoren
WKN A3C6ZS | Anteilsklasse für institutionelle Investoren

VIELEN DANK
FÜR IHRE
AUFMERKSAMKEIT!



FONDSDATEN
Bloomberg | LRIALPH:LX

	<u>Anteilsklasse R</u>	<u>Anteilsklasse I</u>
WKN	A2DXW9	A3C6ZS
ISIN	LU1687250271	LU2406613492
Ausgabeaufschlag	bis zu 5%	0%
Verwaltungsvergütung	bis zu 0,14% p.a.	bis zu 0,14% p.a.
Anlageberatervergütung	bis zu 1,07% p.a.	bis zu 1,00% p.a.
Vertriebsstellenvergütung	bis zu 0,60% p.a.	0%
Verwahrstellenvergütung	bis zu 0,04% p.a.	bis zu 0,04% p.a.
Gewinnverwendung	ausschüttend	ausschüttend
Mindestanlage	100 Euro	100.000 Euro
Performance Fee	15% des Mehrertrags gegenüber Euribor +3% unter Berücksichtigung einer <i>high watermark</i>	
Kapitalverwaltungsgesellschaft	LRI Invest S.A. Luxembourg / www.lri-invest.lu	
Anlageberater	P.A.M. Prometheus Asset Management GmbH	
Depotbank	European Depository Bank S.A. Luxembourg	





Ihre Ansprechpartner

André Kunze | Geschäftsführender Gesellschafter

+49 2173 / 39875-11

andre.kunze@prometheus.de

Boris Dreger | Geschäftsführender Gesellschafter

+49 2173 / 39875-17

boris.dreger@prometheus.de

P.A.M. Prometheus Asset Management GmbH | Elisabeth-Selbert-Str. 19 | 40764 Langenfeld



Wichtige Hinweise

Bei dem vorliegenden Dokument handelt es sich um eine Werbemitteilung.

Die in diesem Dokument enthaltenen Angaben stellen keine Anlageberatung dar.

Alle Meinungsäußerungen geben die aktuelle Einschätzung von P.A.M. Prometheus Asset Management GmbH wieder, die sich ohne vorherige Ankündigung ändern kann. Prognosen sind kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Wertentwicklung. Prognosen basieren auf Annahmen, Schätzungen, Ansichten und hypothetischen Modellen oder Analysen, die sich als nicht zutreffend oder nicht korrekt herausstellen können. Wertentwicklungen der Vergangenheit, simuliert oder tatsächlich realisiert, sind kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.

Dieses Dokument und die in ihm enthaltenen Informationen dürfen nur in solchen Staaten verbreitet oder veröffentlicht werden, in denen dies nach den jeweils anwendbaren Rechtsvorschriften zulässig ist. Der direkte oder indirekte Vertrieb dieses Dokuments in den USA sowie dessen Übermittlung an oder für Rechnung von US-Personen oder an in den USA ansässige Personen sind untersagt.

Die P.A.M. Prometheus Asset Management GmbH ist im Rahmen der Anlageberatung gem. § 1 Abs. 1a Satz 2 Nr. 1 und 1a KWG ausschließlich auf Rechnung und unter Haftung der NFS Netfonds Financial Service GmbH (NFS), Heidenkampsweg 73, 20097 Hamburg tätig.

P.A.M. Prometheus Asset Management GmbH | Stand: 6. März 2024