

alphatrend Fund

Der All-Wetter-Fonds | Regelbasiert. Diversifiziert.

WKN: A2DXW9
ISIN: LU1687250271
(Anteilklasse R)

WKN: A3C6ZS
ISIN: LU2406613492
(Anteilklasse I)

www.alphatrend-fund.de



Stand: 31.08.2023

Werbung | Diese Präsentation ist ausschließlich für Vertriebspartner und professionelle Investoren bestimmt.



alphatrend Fund | Wertentwicklung

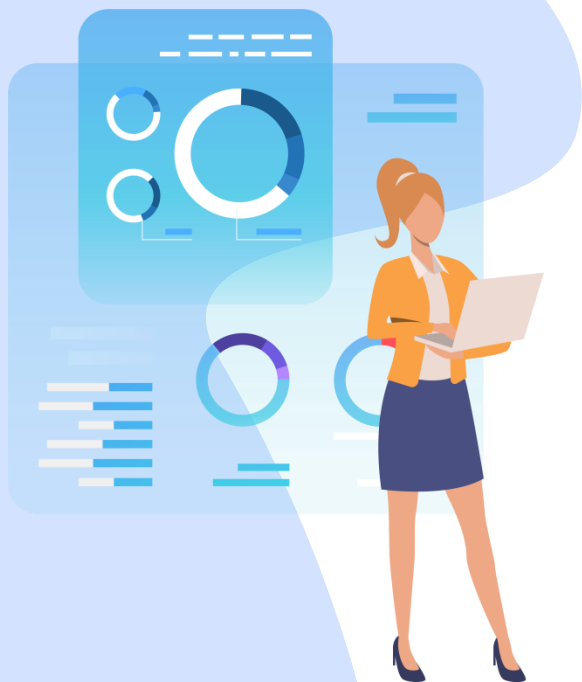
01.02.2019 – 31.08.2023: Rendite p.a. 5,47% max. Verlust -10,40%



Wertentwicklung in % in EUR

	Jan	Feb	Mrz	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	Jahr
2023	0,53	0,38	-0,04	-0,18	-1,21	3,19	-1,08	-3,38					-1,88
2022	-1,62	-3,02	1,05	-1,49	-2,59	-1,65	7,46	-2,89	2,93	-0,61	3,71	-3,17	-2,46
2021	-1,57	-0,87	3,43	2,17	-0,96	1,54	4,62	0,59	-4,71	6,01	0,26	1,18	11,81
2020	1,66	0,86	1,07	1,18	2,09	-1,52	1,61	2,31	-3,57	-2,85	3,35	2,29	8,53
2019	1,29	1,19	3,18	1,27	-2,11	4,76	0,60	2,91	-4,24	-2,84	4,79	0,42	11,31

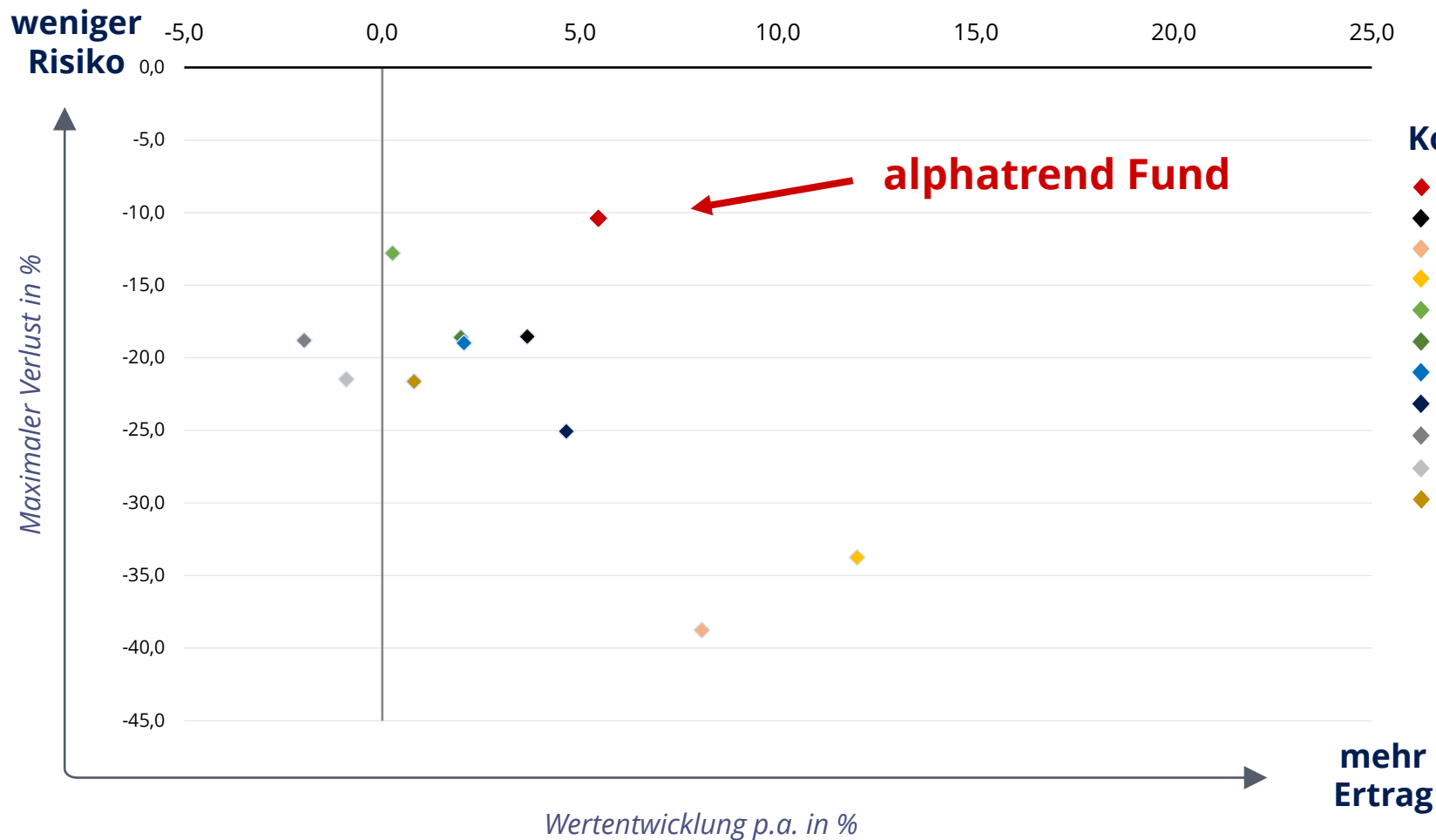
50% Aktien+50% Anleihen = Je 50% in den Morningstar-Kategorie-Durchschnitten Aktien weltweit Standardwerte Blend und Anleihen Global EUR-hedged
Quelle: Morningstar. Alle Daten per 31.08.2023





alphatrend Fund | attraktives Risiko-Ertrags-Profil

Max. Verlust zu Wertentwicklung: 01.02.2019 – 31.08.2023



Korrelationen

- ◆ **1,00** **alphatrend Fund R**
- ◆ **0,49** Mix_50% Globale Aktien - 50%
- ◆ **0,38** DAX
- ◆ **0,49** MSCI World
- ◆ **0,41** Mischfonds EUR defensiv – Global
- ◆ **0,43** Mischfonds EUR ausgew. – Global
- ◆ **0,41** Mischfonds EUR flexibel – Global
- ◆ **0,43** Mischfonds EUR aggressiv – Global
- ◆ **0,39** Staatsanleihen Global
- ◆ **0,35** Unternehmensanleihen IG Global
- ◆ **0,28** Unternehmensanleihen HY Global



Was andere sagen. | FUCHS-Kapital

In seiner Ausgabe vom 21.01.2021 bespricht und analysiert der Kapitalmarkt-Newsletter **FUCHS-Kapital** ausführlich den **alphatrend Fund**.

Fazit:

Der **alphatrend Fund** eignet sich aufgrund seiner breiten Streuung als Basisinvestment für ertragsorientierte Investoren mit einem mittleren und langfristigen Anlagehorizont. Daneben ist er wegen seiner geringen Korrelation zu reinen Aktien-Investments als defensive Absicherungsergänzung für ein offensiv ausgerichtetes Portfolio geeignet.



Durch einen <KLICK> auf das Bildelement gelangen Sie zur Analyse von FUCHS-Kapital.





alphatrend Fund | Doppelstrategie

Wo wird investiert?

Hochliquide Einzelaktien

(mit Währungsabsicherung in EUR)

Abbott Labs, AbbVie, Accenture, Adobe Systems, Advanced Micro, Alphabet, Amazon, American Tower, AON plc, Apple, Applied Materials, ASML Holdings NV, Avago / Broadcom, Bank of America, Barrick Gold, Berkshire Hathaway, Boeing, Caterpillar, Chevron, Cisco, Coca Cola, Comcast, Conoco Phillips, Costco Wholesale, Danaher, Eli Lilly, ExxonMobil, Franco Nevada, Goldman Sachs, Home Depot, Honeywell Int'l, IBM Corp., Intel, Intuit, J P Morgan, Johnson & Johnson, Linde, Lowe's Co., Master Card, McDonald's, Merck, Meta Platforms, Microsoft, Netflix, NextEra Energy, Nike, Nvidia, Oracle, PayPal, Pepsico, Pfizer, Procter & Gamble, Prologis, Qualcomm, Raytheon Technologies, Rio Tinto ADR, S&P Global, Salesforce, Sanofi-Aventis, SAP AG ADS, ServiceNow, Sony Group ADR, Starbucks, Target, Tesla, Texas Instruments, Thermo Fisher Scientific, Unilever plc, Union Pacific, United Health, United Parcel Service, Verizon, Visa, Walmart, Walt Disney, Wells Fargo

Internationale Aktienmärkte

Über Index-Futures: DAX, EuroStoxx 50, STOXX EUROPE 600, SMI, UK FTSE 100, Dow Jones, Nasdaq, Russell 2000, S&P 500, S&P Midcap, NIKKEI, VIX

Internationale Rentenmärkte

Über Index-Futures: Deutschland Euro-Bund, Deutschland Euro-BUXL, Frankreich Euro-OAT, Italien Euro-BTP, Euro-Bobl, UK Gilts, U.S. 10 Year Treasury Note, U.S. 5 Year Treasury Note, U.S. 2 Year Treasury Note, U.S. 30 year T-Bond, Ultra 10-Year U.S. Treasury Note, Ultra U.S. Treasury Bond



alphatrend Fund | Doppelstrategie

Wie wird investiert?

Strategie	Investments	Positionierung	Time in Market	Haltedauer
GALAXY 50%	Einzelaktien	LONG/FLAT	40%	Ø 12 Tage
	Aktien-Indizes			
HEDGE+ 50%	Aktien-Indizes	LONG/SHORT	100%	Ø 14 Tage
	Renten-Indizes			



Bei GALAXY handelt es sich um eine rein regelbasierte Anlagestrategie, mit der in sehr liquide Aktien, die an einer US-Börse gelistet sind, und in Aktien-Indizes investiert wird. Die Strategie ist kurzfristig opportunistisch ausgerichtet. Dabei wird in Aktien/Aktien-Indizes sowohl zyklisch als auch antizyklisch angelegt. Die Haltedauer der einzelnen Positionen beträgt durchschnittlich 12 Tage. Die Strategie ist entweder LONG in einer Aktie mit einem Gewicht von ca. 0,5% bis 2,5% investiert oder FLAT in Cash. Es gibt KEINE SHORT-Positionen in GALAXY.



HEDGE+ investiert rein regelbasiert in die wichtigsten und liquidesten globalen Aktien- und Renten-Indizes über Futures. Es wird sowohl zyklisch als auch antizyklisch in Märkte investiert. HEDGE+ ist in den einzelnen Indizes entweder LONG (auf steigende Kurse) oder SHORT (auf fallende Kurse) ausgerichtet. Mit einer Haltedauer der Positionen von durchschnittlich 14 Tagen ist HEDGE+ kurzfristig opportunistisch ausgerichtet.

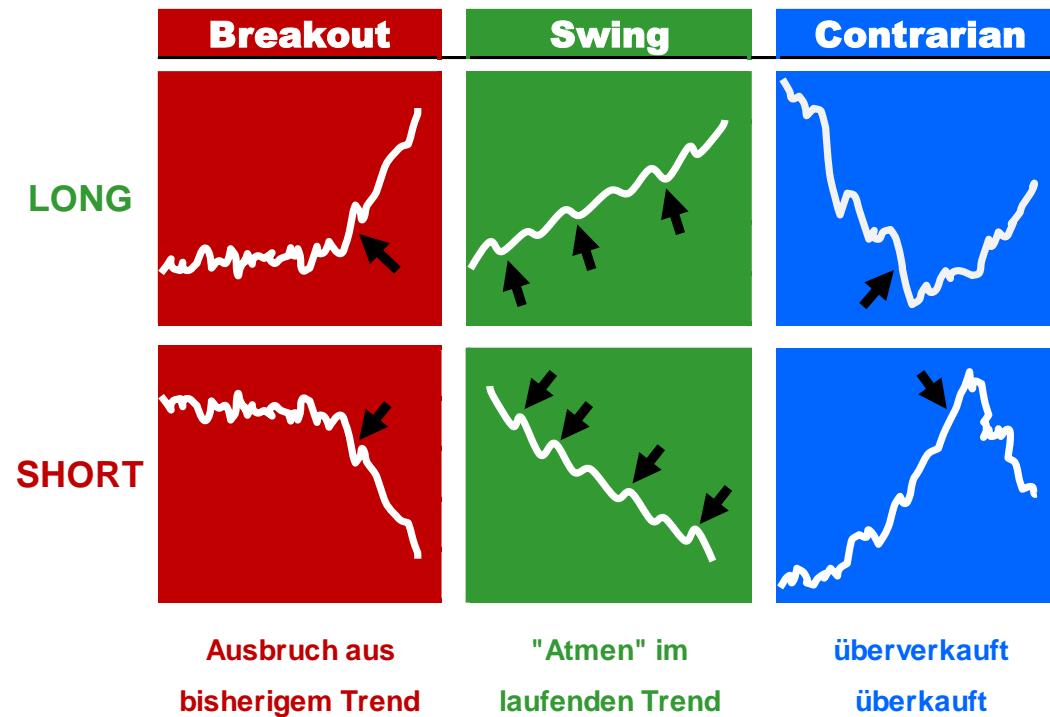




alphatrend Fund | Doppelstrategie

Wie wird investiert?

Im Kern geht es um die Analyse und Ausnutzung der Kursbewegungen.

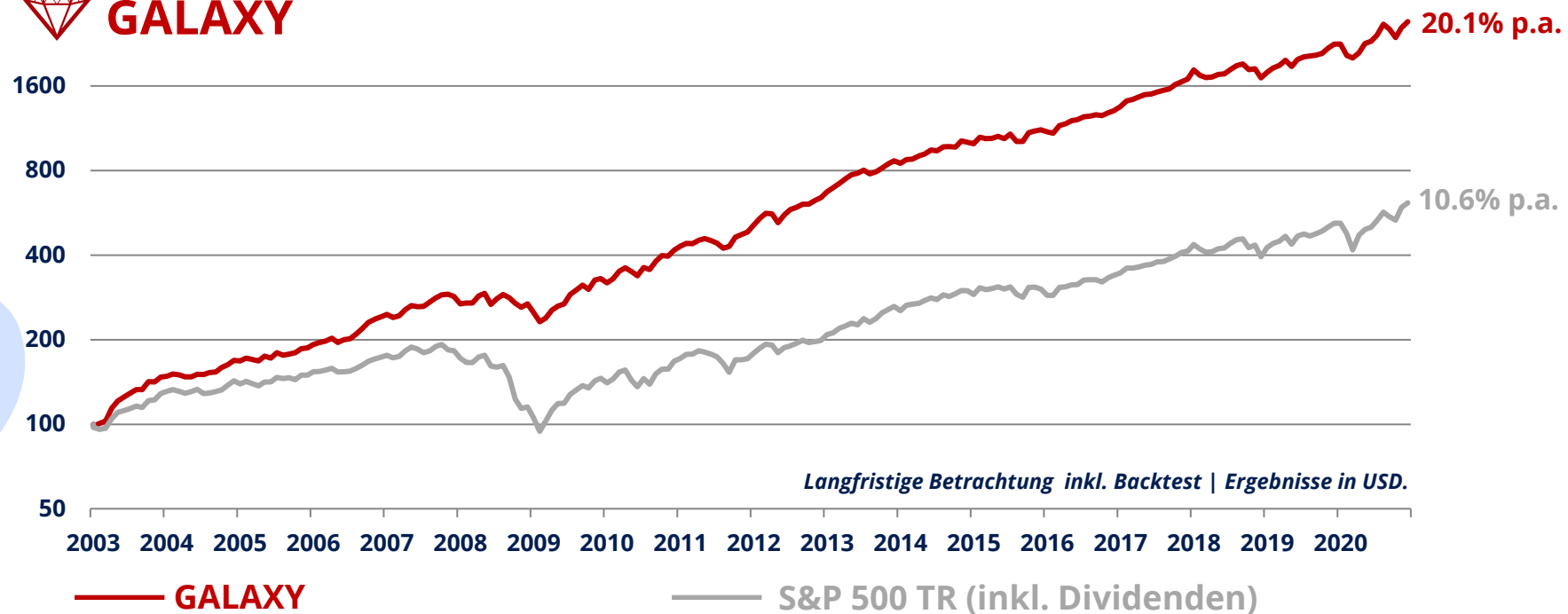




alphatrend Fund | Doppelstrategie

Wie wird investiert?

 **GALAXY**



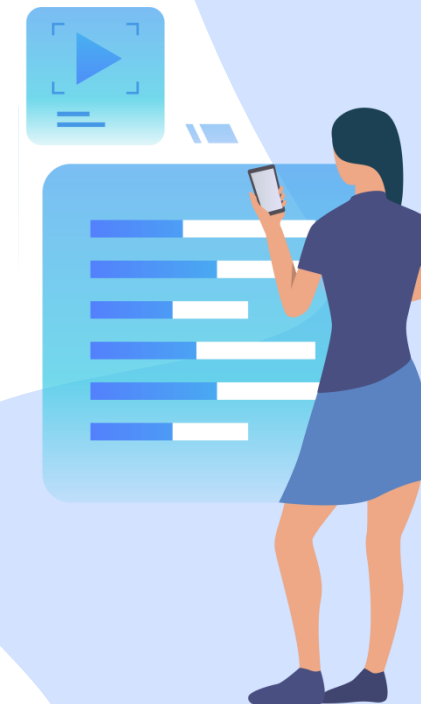
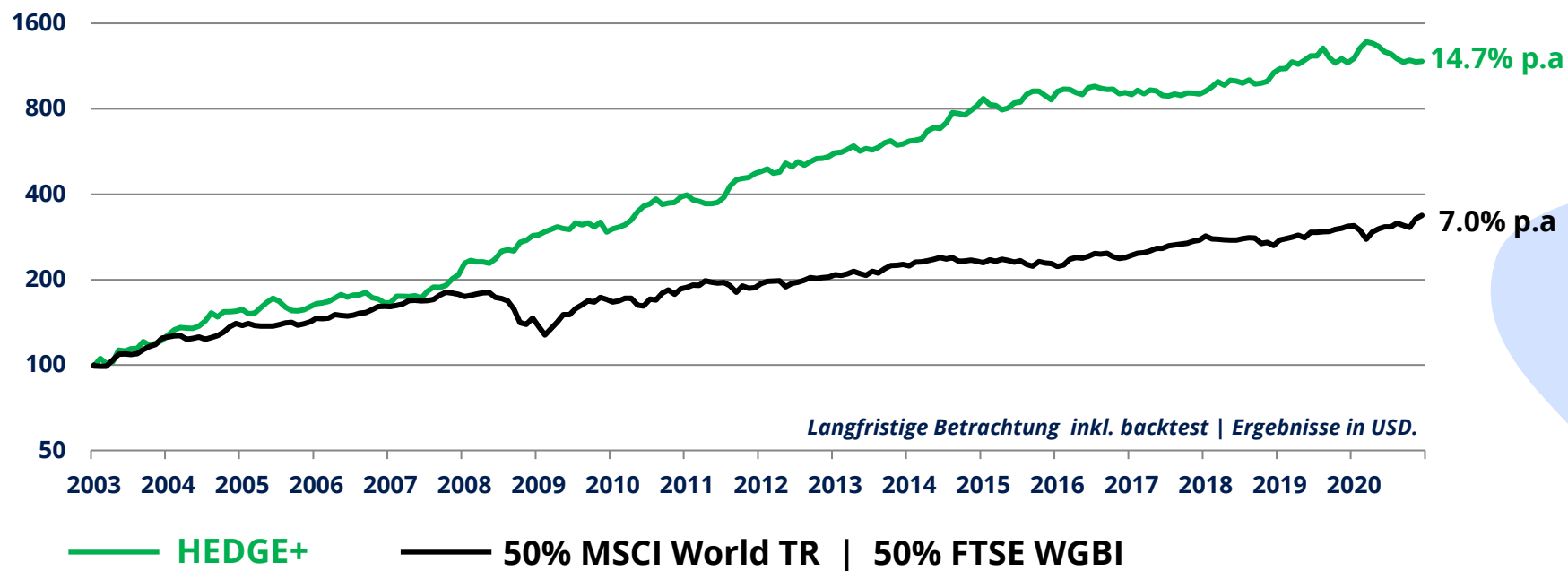
Inklusive: Tradingkosten | Exklusive: Hedgingkosten, Dividendenerträge, Verwaltungsvergütung, Kosten für Fondsadministration





alphatrend Fund | Doppelstrategie

Wie wird investiert?



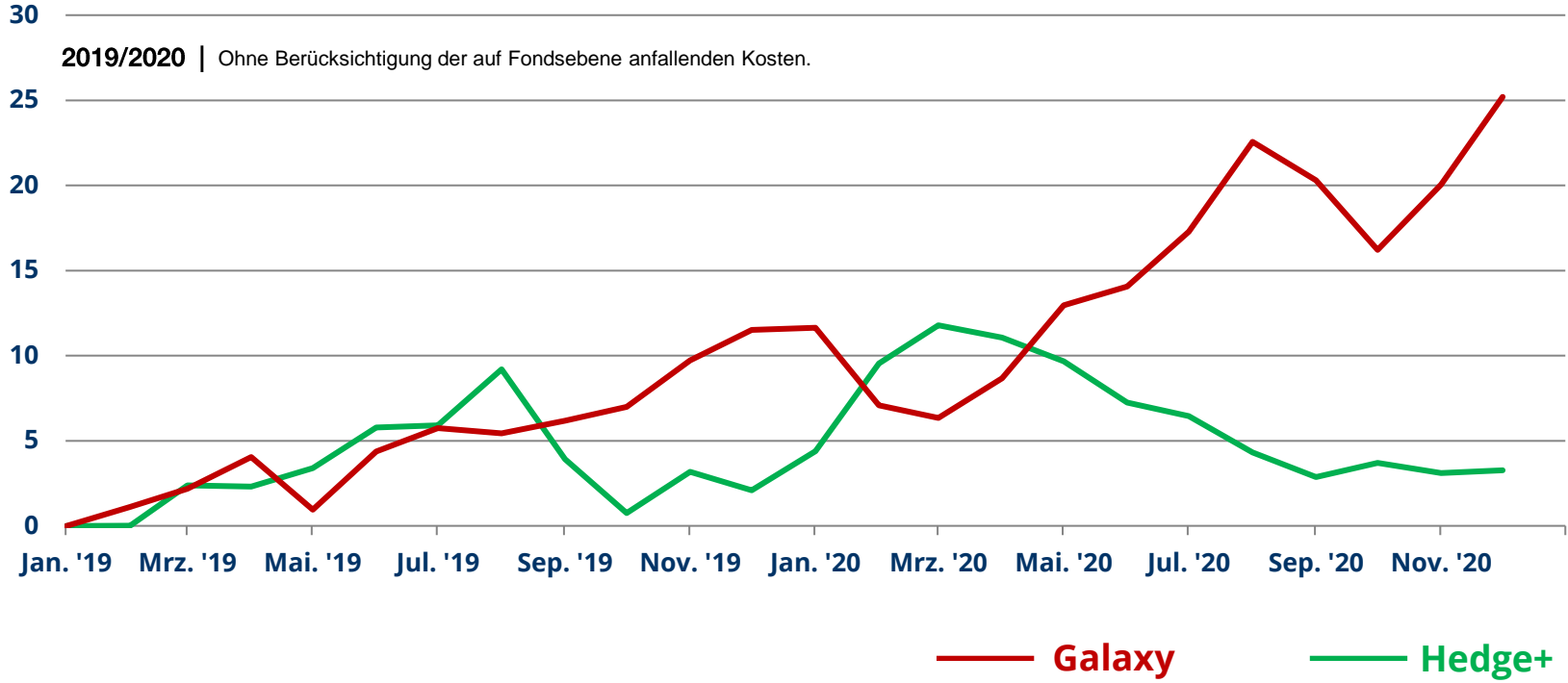
Inklusive Tradingkosten | Exklusive Hedgingkosten, Verwaltungsvergütung, Kosten für Fondsadministration



alphatrend Fund | Doppelstrategie

Wie wird investiert?

GALAXY | **HEDGE+**



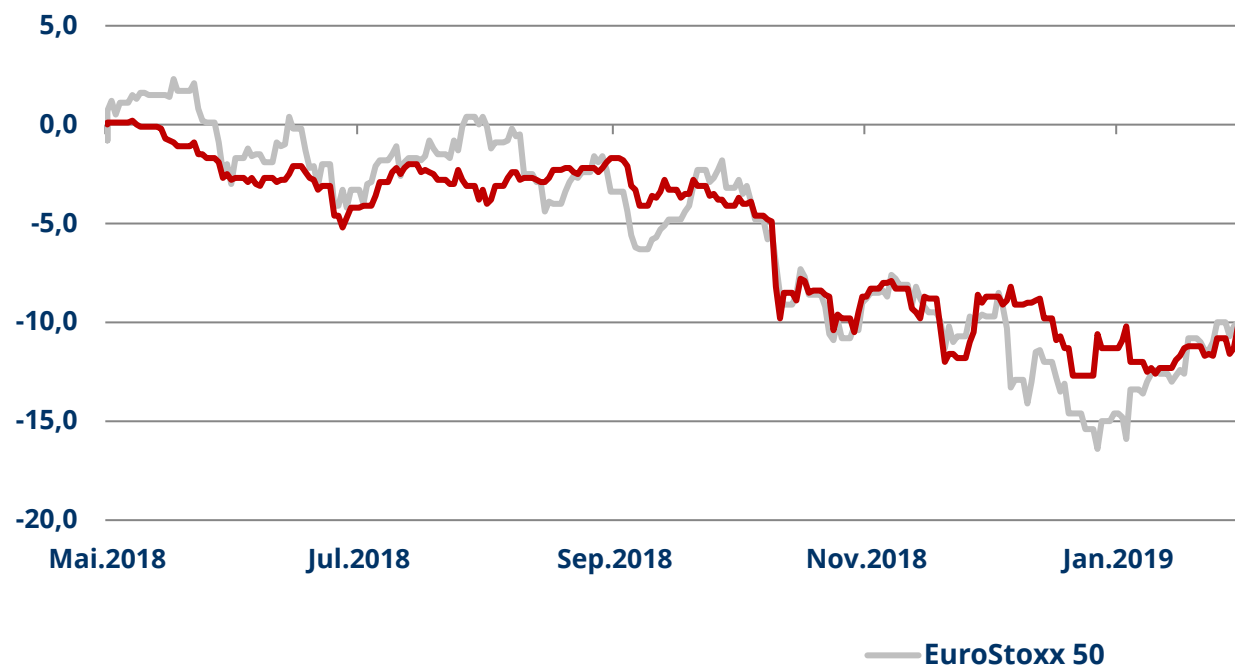
Quelle: Prometheus | Alle Daten per 31.12.2020.





alphatrend Fund | Doppelstrategie

Besonderheit: Entwicklung in der Auflagephase



Wertentwicklung in % in EUR

Die einzelnen Strategien des alphas trend Fund wurden ab dem Fondsstart am 23.04.2018 bis zum 04.02.2019 sukzessive implementiert. Der Fonds entwickelte sich in dieser Phase daher wie ein Aktieninvestment.

Seit dem 04.02.2019 setzt der Fonds die geplanten Strategien vollständig um.



alphatrend Fund | Wertentwicklung

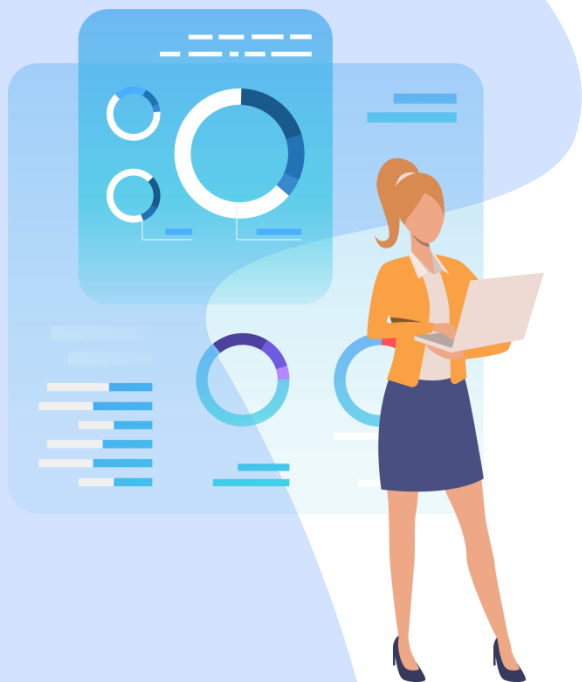
Ergebnisse seit vollständiger Integration der Strategien



Wertentwicklung in % in EUR

	Jan	Feb	Mrz	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	Jahr
2023	0,53	0,38	-0,04	-0,18	-1,21	3,19	-1,08	-3,38					-1,88
2022	-1,62	-3,02	1,05	-1,49	-2,59	-1,65	7,46	-2,89	2,93	-0,61	3,71	-3,17	-2,46
2021	-1,57	-0,87	3,43	2,17	-0,96	1,54	4,62	0,59	-4,71	6,01	0,26	1,18	11,81
2020	1,66	0,86	1,07	1,18	2,09	-1,52	1,61	2,31	-3,57	-2,85	3,35	2,29	8,53
2019	1,29	1,19	3,18	1,27	-2,11	4,76	0,60	2,91	-4,24	-2,84	4,79	0,42	11,31

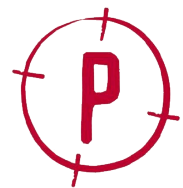
50% Aktien+50% Anleihen = Je 50% in den Morningstar-Kategorie-Durchschnitten Aktien weltweit Standardwerte Blend und Anleihen Global EUR-hedged
Quelle: Morningstar. Alle Daten per 31.08.2023





alphatrend Fund | Fondsdaten

	<u>Anteilkategorie R</u>	<u>Anteilkategorie 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 ggü. 3-Monats-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	



alphatrend Fund | Auf einen Blick

- Start: 02.2019

- Regelbasierter Strategiefonds

* Sehr liquide Einzelaktien und Cash mit flexibler Quote, NUR LONG

* Internationale Aktienmärkte über Indizes, LONG und SHORT

* Internationale Anleihenmärkte über Indizes, LONG und SHORT

- Attraktives Risiko-Ertrags-Profil / geringer maximaler Verlust

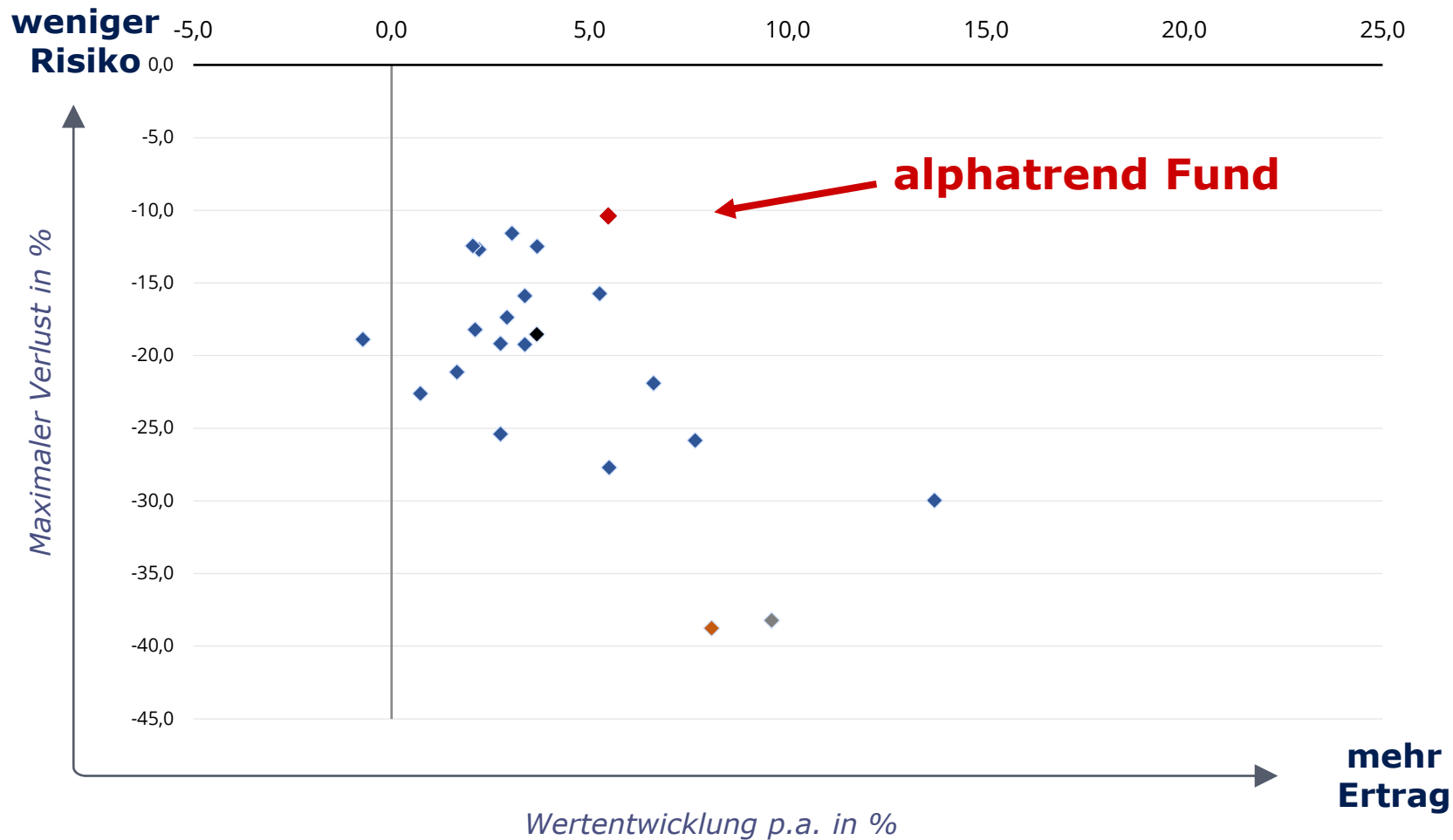
- Geringe Korrelationen





alphatrend Fund | attraktives Risiko-Ertrags-Profil

Max. Verlust zu Wertentwicklung : 01.02.2019 – 31.08.2023



- ◆ **alphatrend Fund (Anteilklasse R)**
- ◆ Mix_50% Gl. Aktien - 50% Gl. Anleihen
- ◆ DAX
- ◆ EURO STOXX 50
- ◆ ACATIS Datini Valueflex Fonds A
- ◆ Acatis Gané Value Event Fonds A
- ◆ Berenberg Variato R
- ◆ BGF Global Allocation A2
- ◆ Carmignac Patrimoine A EUR Acc
- ◆ DJE - Zins & Dividende PA (EUR)
- ◆ DWS Concept Kaldemorgen EUR LC
- ◆ DWS Top Dividende LD
- ◆ Ethna-AKTIV A
- ◆ Frankfurter Aktienfds für Stiftungen T
- ◆ FvS SICAV Multiple Opportunities R
- ◆ JPM Global Income A (acc) EUR
- ◆ Kapital Plus A EUR
- ◆ M&G Optimal Income Fam A Acc EUR
- ◆ Nordea 1 - Stable Return BC EUR
- ◆ ODDO BHF Polaris Moderate DRW EUR
- ◆ Sauren Global Balanced A
- ◆ Siemens Balanced



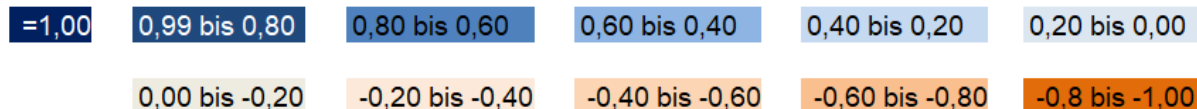
alphatrend Fund | niedrige Korrelationen = Teamplayer

Korrelationsmatrix: 01.02.2019 – 31.08.2023

Investment	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	
1 alphatrend Fund	1,00																						
2 Mix_50% Globale Aktien - 50% Globale Anleihen	0,49	1,00																					
3 DAX	0,38	0,86	1,00																				
4 EURO STOXX 50	0,43	0,86	0,97	1,00																			
5 ACATIS Datini Valueflex Fonds A	0,45	0,84	0,70	0,72	1,00																		
6 Acatis Value Event Fonds A	0,44	0,92	0,82	0,82	0,78	1,00																	
7 Berenberg Variato R A	0,39	0,88	0,71	0,68	0,84	0,81	1,00																
8 BGF Global Allocation A2	0,42	0,92	0,75	0,74	0,78	0,85	0,83	1,00															
9 Carmignac Patrimoine A EUR Acc	0,42	0,73	0,73	0,73	0,64	0,76	0,67	0,64	1,00														
10 DJE - Zins & Dividende PA (EUR)	0,49	0,90	0,77	0,76	0,79	0,83	0,86	0,91	0,66	1,00													
11 DWS Concept Kaldemorgen EUR LC	0,35	0,89	0,88	0,87	0,72	0,87	0,74	0,88	0,67	0,86	1,00												
12 DWS Top Dividende LD	0,33	0,81	0,79	0,80	0,65	0,72	0,66	0,83	0,54	0,80	0,87	1,00											
13 Ethna-AKTIV A	0,27	0,60	0,42	0,42	0,45	0,58	0,49	0,60	0,50	0,54	0,59	0,50	1,00										
14 Frankfurter Aktienfds für Stiftungen T	0,34	0,85	0,79	0,75	0,74	0,79	0,75	0,82	0,61	0,79	0,85	0,73	0,65	1,00									
15 FvS SICAV Multiple Opportunities R	0,50	0,89	0,69	0,67	0,74	0,80	0,84	0,86	0,62	0,87	0,80	0,75	0,59	0,76	1,00								
16 JPM Global Income A (acc) EUR	0,35	0,92	0,86	0,86	0,77	0,84	0,82	0,81	0,74	0,80	0,87	0,81	0,56	0,85	0,81	1,00							
17 Kapital Plus A EUR	0,53	0,92	0,79	0,79	0,81	0,81	0,86	0,79	0,68	0,84	0,76	0,65	0,46	0,73	0,84	0,85	1,00						
18 M&G Optimal Income Fam A Acc EUR Acc	0,26	0,88	0,80	0,78	0,70	0,83	0,79	0,72	0,71	0,74	0,79	0,66	0,47	0,75	0,73	0,92	0,86	1,00					
19 Nordea 1 - Stable Return BC EUR	0,40	0,73	0,66	0,65	0,50	0,64	0,61	0,68	0,52	0,70	0,71	0,68	0,30	0,49	0,67	0,69	0,73	0,65	1,00				
20 ODDO BHF Polaris Moderate DRW EUR	0,53	0,96	0,82	0,81	0,80	0,92	0,88	0,87	0,75	0,86	0,84	0,74	0,59	0,78	0,86	0,89	0,94	0,88	0,74	1,00			
21 Sauren Global Balanced A	0,15	0,81	0,79	0,77	0,70	0,79	0,78	0,77	0,74	0,73	0,83	0,74	0,65	0,84	0,67	0,88	0,68	0,80	0,50	0,77	1,00		
22 Siemens Balanced	0,46	0,97	0,86	0,87	0,76	0,89	0,83	0,86	0,72	0,85	0,87	0,78	0,56	0,82	0,84	0,94	0,92	0,93	0,73	0,96	0,81	1,00	



alphatrend Fund





Gern stellen wir Ihnen weitere Informationen zur Verfügung und freuen uns auf den Austausch mit Ihnen!

www.alphatrend-fund.de



Kontakt

P.A.M. Prometheus Asset Management GmbH

Elisabeth-Selbert-Straße 19
40764 Langenfeld



info@prometheus.de



02173 398 750



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. Die in diesem Dokument enthaltenen Informationen genügen nicht allen gesetzlichen Anforderungen zur Gewährleistung der Unvoreingenommenheit von Anlageempfehlungen und Anlagestrategieempfehlungen und unterliegen keinem Verbot des Handels vor der Veröffentlichung solcher Empfehlungen. Die Vervielfältigung, Veröffentlichung sowie die Weitergabe des Inhalts in jedweder Form ist nicht gestattet.

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.