

alphatrend Fund

Der All-Wetter-Fonds | Regelbasiert. Diversifiziert.

WKN: A2DXW9
ISIN: LU1687250271
(Anteilklasse R)

WKN: A3C6ZS
ISIN: LU2406613492
(Anteilklasse I)

www.alphatrend-fund.de



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



LSEG Lipper Fund Awards

2024 Winner
Germany

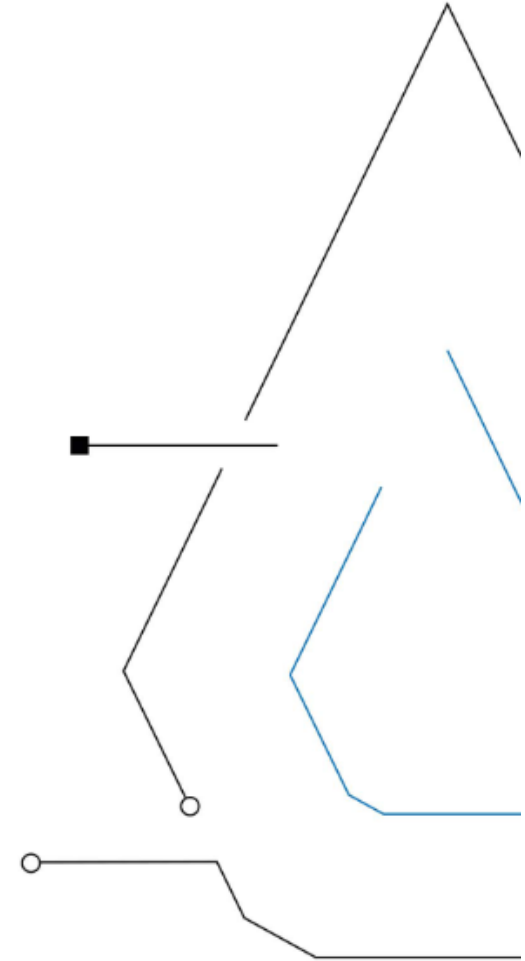
Fundsolution Alphatrend Fund R Dis

LRI Invest SA

Advised by PAM Prometheus Asset Management GmbH

Best Fund over 3 Years

Absolute Return EUR High



Tom Roseen
Principal, Lipper Global Research
LSEG Data & Analytics

Emily Prince
Group Head of Analytics
LSEG



LSEG

Was andere sagen.

DER FONDS ANALYST

Professionelle Investmentstrategien mit den weltweit besten Aktien-, Renten- und Spezial-Fonds
Eine Publikation der Greiff Research Institut GmbH

Liebe Leserinnen und Leser,

Mischfonds oder Multi-Asset Fonds gibt es mit unterschiedlichster Ausgestaltung!

Ob als reine herkömmliche Aktien- oder Rentemischfonds, ob mit aktiver Kasse-Haltung, ggf. mit Options-Overlay oder auch mit dem Einsatz von Rohstoffen/Edelmetallen oder gar Krypto-Anlagen, die Spielweise für aktive Manager ist sehr groß. Eine Alternative zu den oben genannten Lösungen bieten hier auch regelbasierte Ansätze auf diversiver Basis. Eine solche Strategie, die global in Einzelaktien, Aktienindex- und Rentenindex-, Futures investiert und dadurch positive Ergebnisse loggestützt von der Marktentwicklung ermöglicht, stammt aus dem Hause Prometheus Asset Management (P.A.M.) Deren alphanthred Fund R (WKN A2DKW9) feierte kürzlich das fünfjährige Bestehen. Da dieser Fonds seit Auflage mit ansprechenden Ergebnissen und einem tollen Chance-Risiko-Verhältnis glänzt, möchten wir Ihnen diesen Ansatz einmal näher vorstellen.

„Zeit für eine neue Perspektive“ lautet der passende Slogan zum Fonds!

Auf der eigens für den Fonds kreierten Homepage www.alphanthred-fund.de findet man tagesaktuell alle wichtigen Informationen, so dass ein hohes Maß an Transparenz gewährleistet ist. Doch wer verbringt sich hinter diesem Konzept? Die von Andre Kunze und Marc Piesdig 2005 gegründete und stets inhabergeführte Prometheus-Gruppe hat ihren Sitz in Langenfeld. Aktuell verwaltet man über 120 Mio. Euro, worauf auf die für den Fonds verantwortliche P.A.M. 41 Mio. EUR entfallen. P.A.M.

Wichtigen Hinweis: Zu möglichen Risiken und Interessenkonflikten bei den vorgestellten Anlagen bestehen die Wertpapiere ausschließlich auf der letzten Seite und unter www.derfondsanalyst.de

ist auf die Entwicklung systematischer, rein regelbasierter Anlagestrategien mit aktivem Risikomanagement spezialisiert. Der alphanthred Fund R wurde zwar bereits 2018 lanciert, allerdings sind die zugrundeliegenden Handelssystematiken erst seit Anfang Februar 2019 vollständig integriert, so dass wir das Startdatum entsprechend auch auf Anfang Februar 2019 legen. Die Ratinghäuser gruppieren den Fonds in unterschiedliche Vergleichsgruppen ein: Fondsweb in der Kategorie Strategiefonds Misch-Strategie „dynamisch“ Welt, Morningstar in Mischfonds EUR flexible Allocation Global und Lipper in den Bereich Alternatives Absolute Return EUR High. Aktuell wird der Fonds seitens Morningstar mit 5 Sternen ausgezeichnet, Fondsweb vergibt 4 Sterne. Ganz frisch wurde der Fonds zudem von Lipper Refinitiv als Sieger und Gewinner des Lipper Fund Awards 2024 über drei Jahre in der Kategorie Absolute Return EUR High ausgezeichnet.

Getreu dem Motto „nur wer anders denkt, kann besser sein“ investiert man hochflexibel in die globalen Aktien- und Rentenmärkte!

Ziel ist es, unabhängig von den Entwicklungen an den Kapitalmärkten positive Einträge in Euro zu erwirtschaften. Dabei strebt man eine mit Aktien mittel- bis langfristig vergleichbare Rendite (6-8 % p.a.) bei deutlich reduzierten Kurschwankungen (Zielvolatilität liegt bei rund 10 %) an. Kern des Anlageprozesses ist ein systematischer, rein regelbasierter Ansatz, der subjektive Einflussfaktoren aus dem Anlageprozess vollständig ausschließt. Stattdessen stellen die auf Basis der Börsenhistorie der letzten Jahrzehnte analysierten und erkannten Verhaltensmuster der Kapitalmärkte das Fundament der Anlagestrategie des Fonds dar. Die Strategie füßt auf Handelsalgorithmen, die per Saldo in über mehr als drei Jahrzehnten entwickelt wurden. Die Ursprünge der im Fonds eingesetzten Handelsstrategien gehen auf David Chetail zurück, der viele

Der Fonds Analyst 15. April 2024

„Die Ergebnisse sind stimmig, die Transparenz ist hoch und die geringe Korrelation zu anderen Produkten und Märkten machen diesen Ansatz zu einer hervorragenden Alternative oder Ergänzung für Mischfonds jeglicher Art.“

Morningstar Rating * * * * *

MMD Ranking 5 Jahre * * * * *

Quelle: Morningstar, Asset Standard. Stand: 04.06.2024





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.



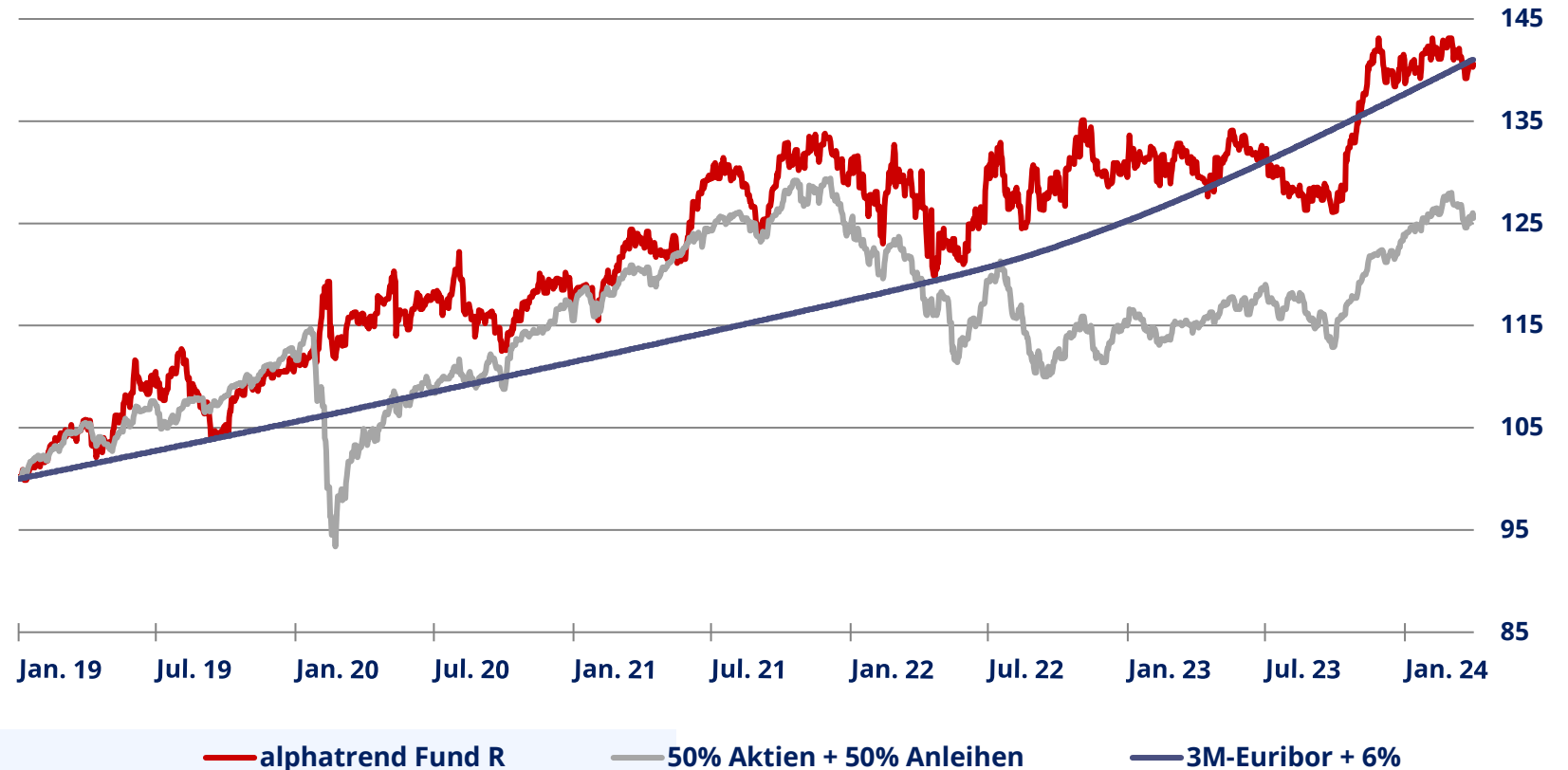
Durch einen **<KLICK>** auf das Bildelement gelangen Sie zur Analyse von FUCHS-Kapital.





alphatrend Fund | Wertentwicklung

01.02.2019 – 30.04.2024: Rendite p.a. 6,71% max. Verlust -10,40%

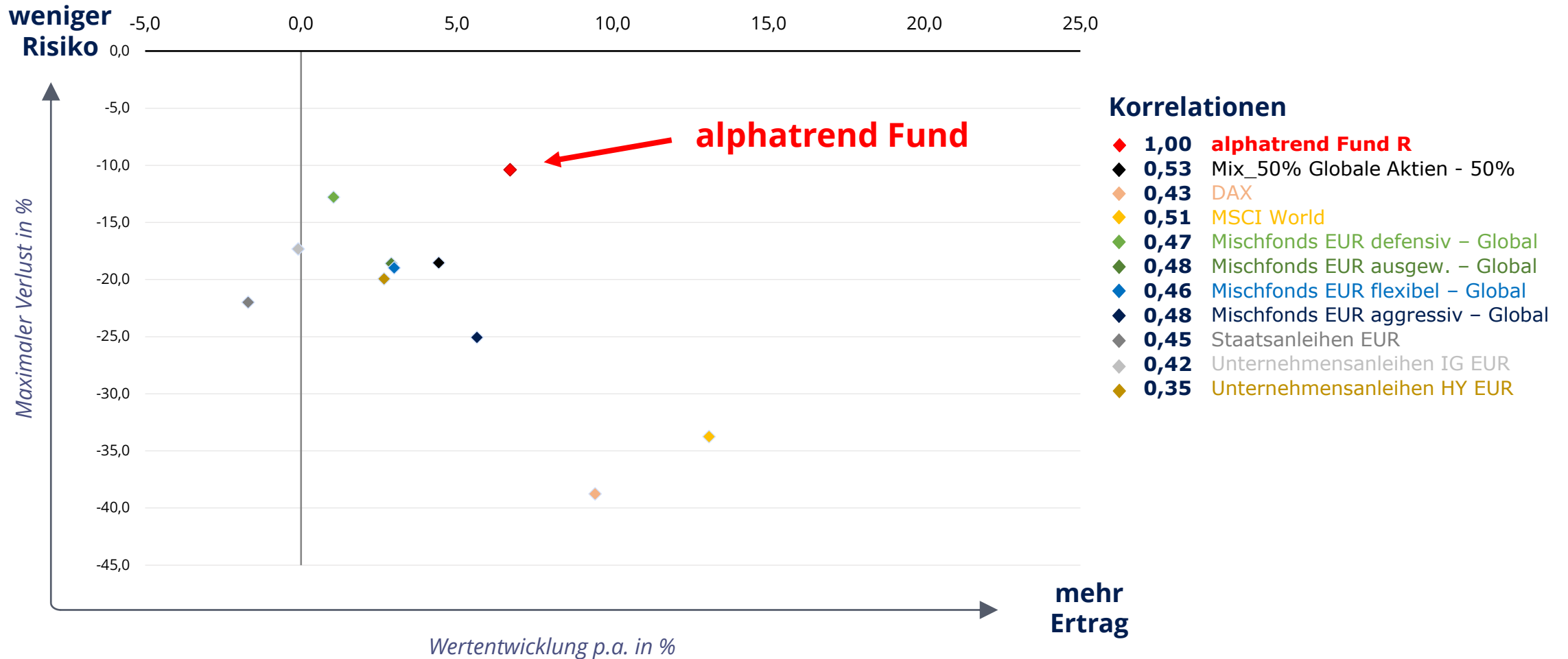


50% Aktien+50% Anleihen = Je 50% in den Morningstar-Kategorie-Durchschnitten Aktien weltweit Standardwerte Blend und Anleihen Global EUR-hedged
Quelle: Morningstar. Alle Daten per 30.04.2024



alphatrend Fund | attraktives Risiko-Ertrags-Profil

Max. Verlust zu Wertentwicklung: 01.02.2019 – 30.04.2024





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	Ø 53%	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.

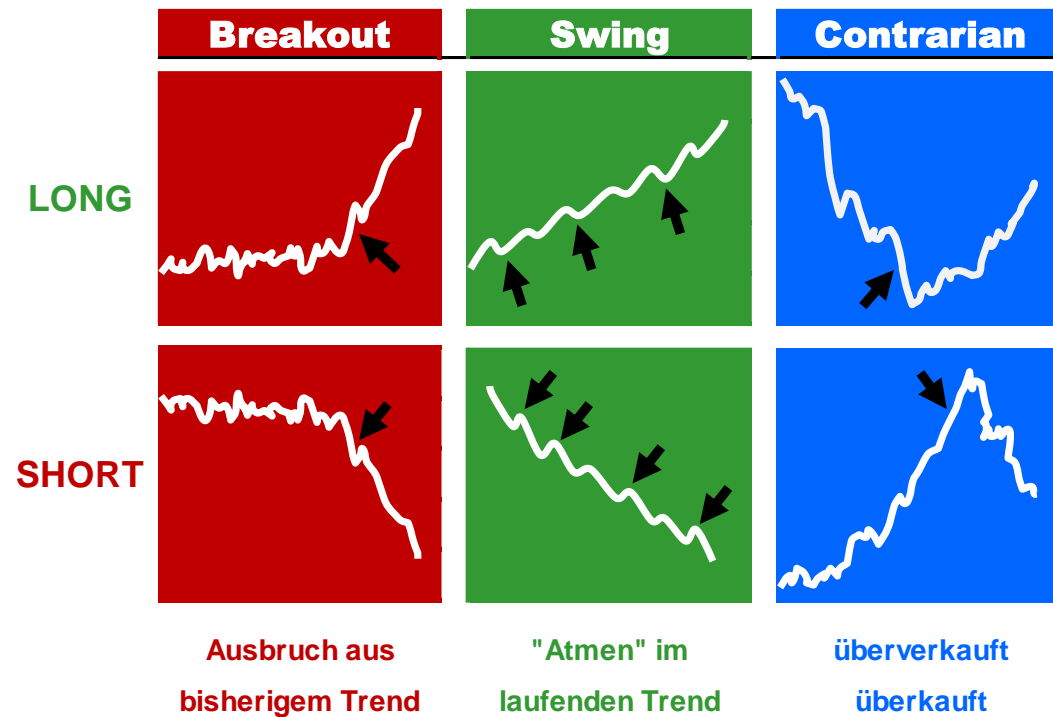




alphatrend Fund | Doppelstrategie

Wie wird investiert?

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

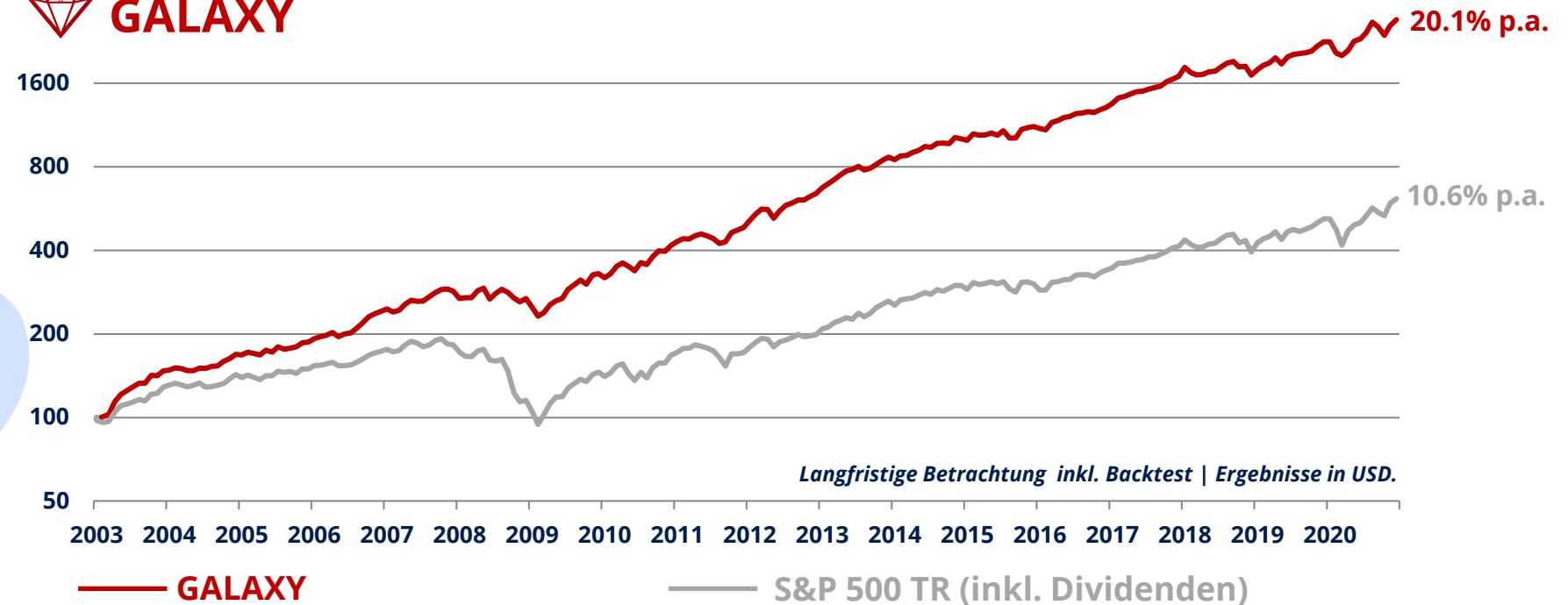




alphatrend Fund | Doppelstrategie

Wie wird investiert?

 **GALAXY**



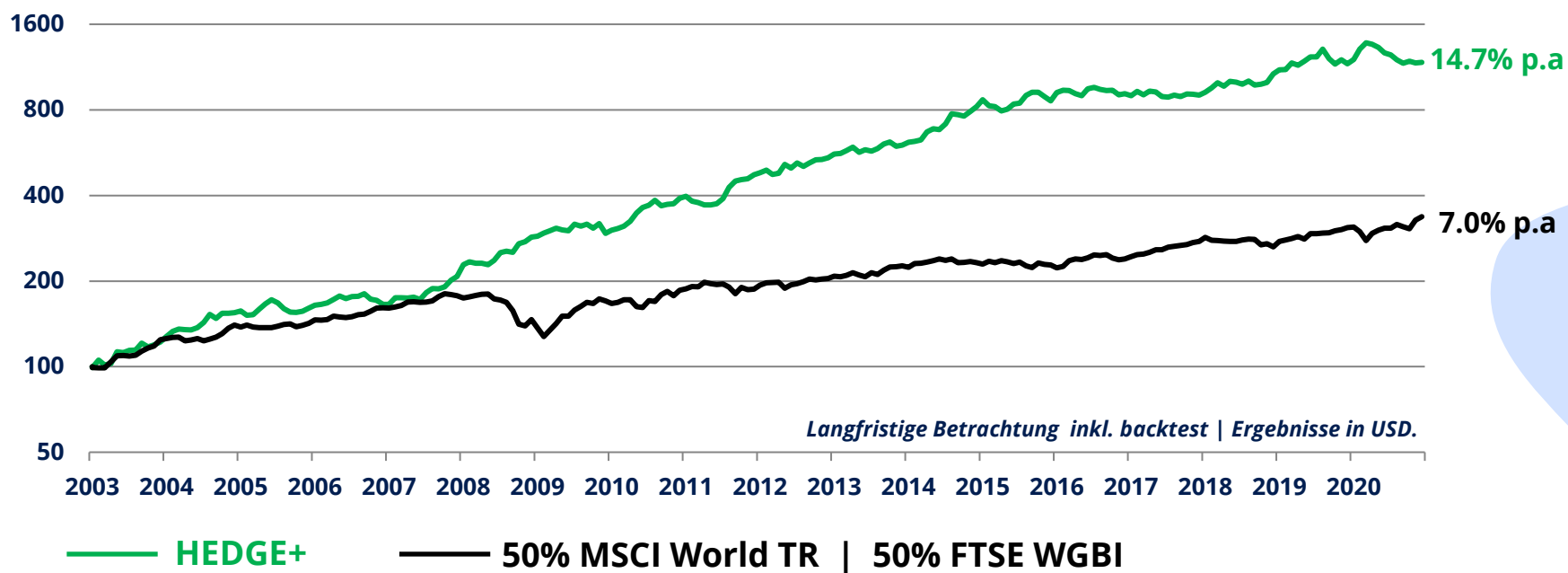
Inklusive: Tradingkosten | Exklusive: Hedgingkosten, Dividendenerträge, Verwaltungsvergütung, Kosten für Fondsadministration





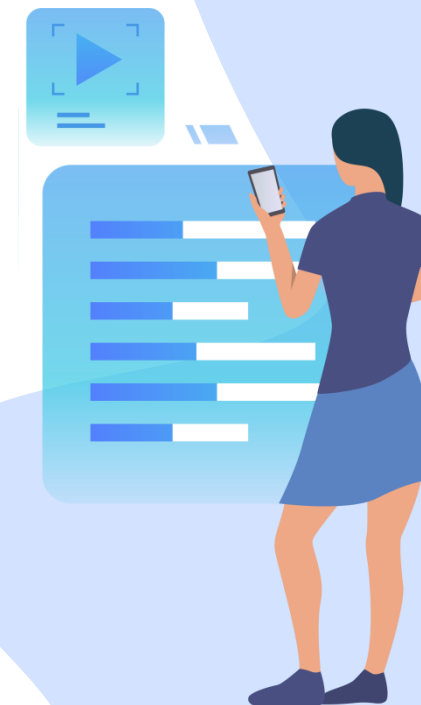
alphatrend Fund | Doppelstrategie

Wie wird investiert?



Inklusive Tradingkosten | Exklusive Hedgingkosten, Verwaltungsvergütung, Kosten für Fondsadministration

Quelle: Morningstar, Prometheus | Alle Daten per 31.12.2020.

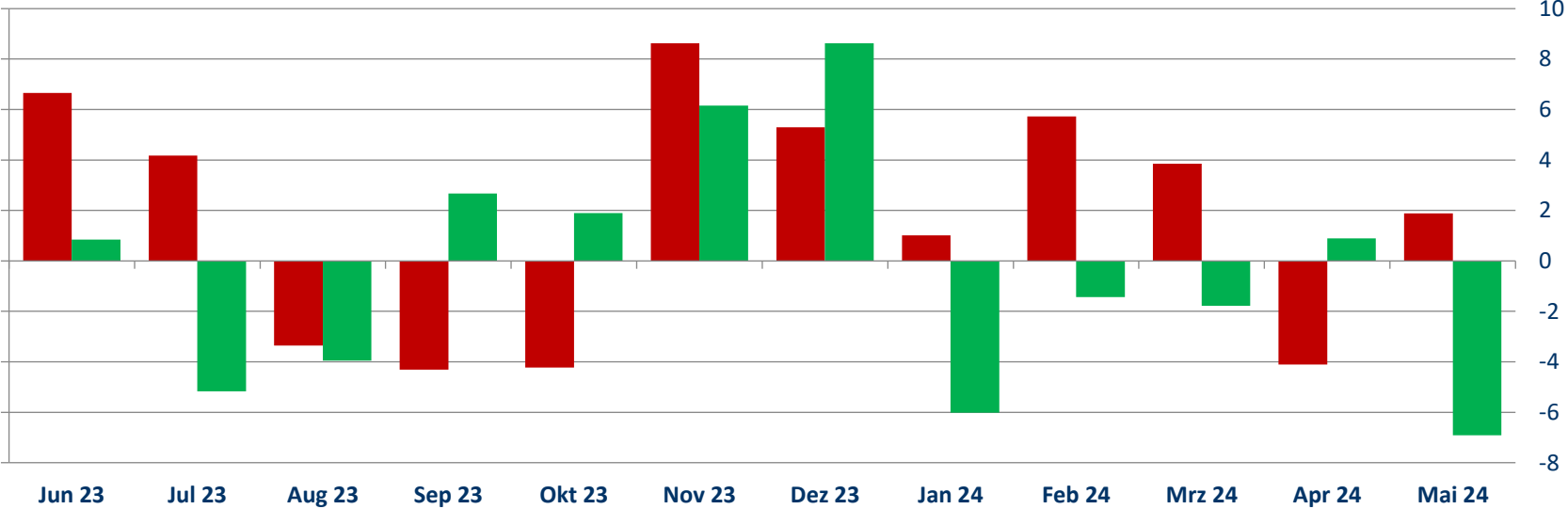




alphatrend Fund | Doppelstrategie

Wie wird investiert?

GALAXY | **HEDGE+**

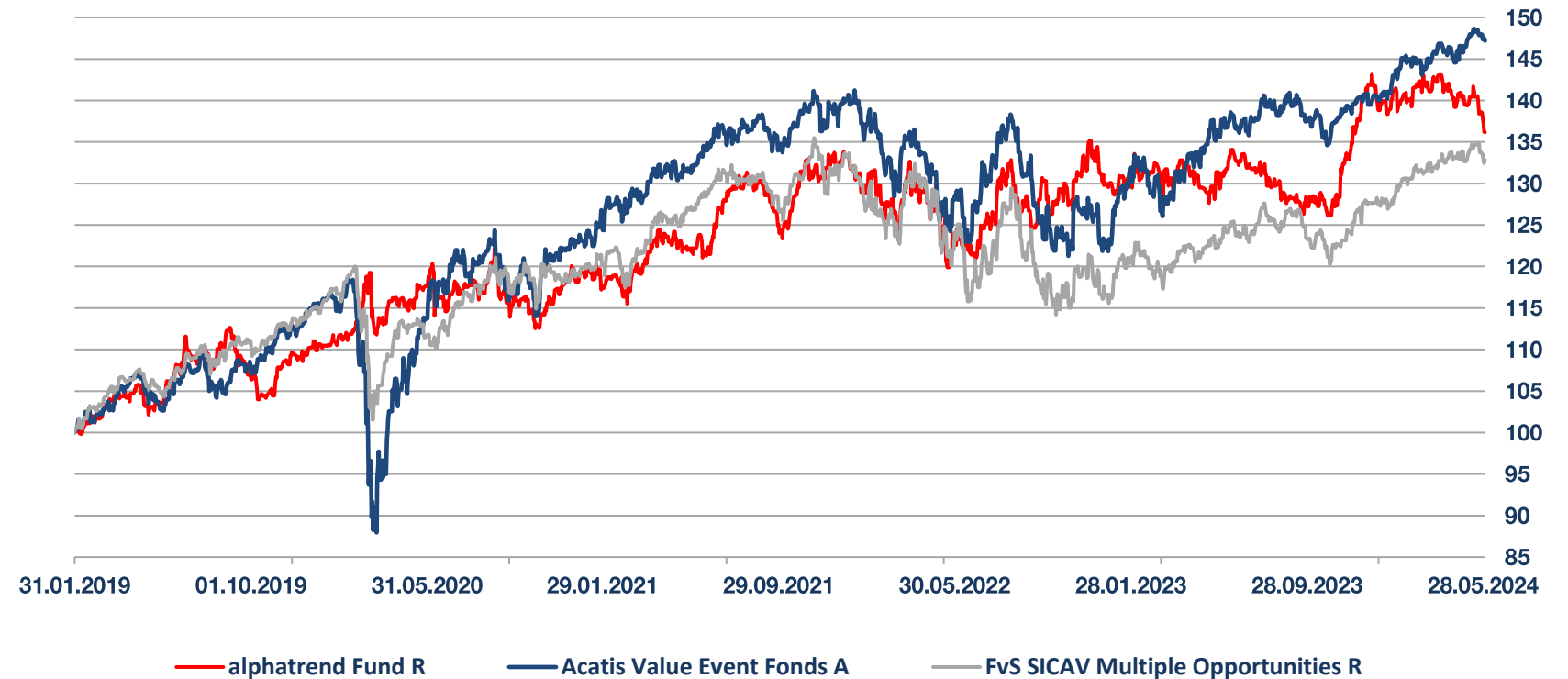


In USD, ohne Berücksichtigung der auf Fondsebene anfallenden Kosten.
Quelle: Prometheus. Stand: 31.05.2024.

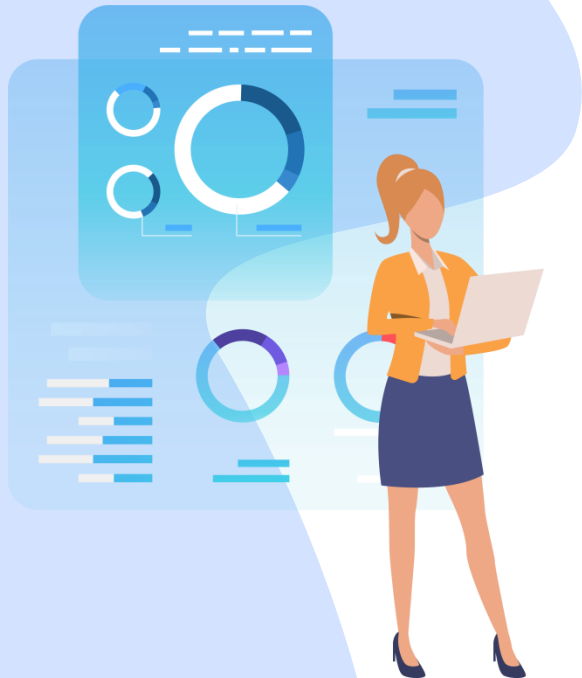


alphatrend Fund im Portfolio

01.02.2019 – 31.05.2024, Wertentwicklung in % in EUR



Quelle: Morningstar. Alle Daten per 31.05.2024





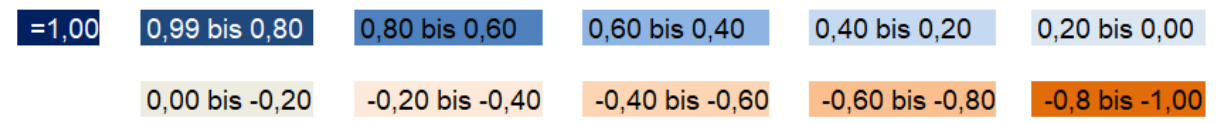
alphatrend Fund | niedrige Korrelationen = Teamplayer

Korrelationsmatrix: 01.02.2019 – 30.04.2024

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	0,53	1,00																				
3 DAX	0,43	0,87	1,00																			
4 EURO STOXX 50	0,46	0,86	0,97	1,00																		
5 ACATIS Datini Valueflex Fonds A	0,51	0,84	0,72	0,73	1,00																	
6 Acatis Value Event Fonds A	0,43	0,90	0,82	0,82	0,76	1,00																
7 Berenberg Variato R A	0,43	0,88	0,72	0,70	0,83	0,80	1,00															
8 BGF Global Allocation A2	0,45	0,92	0,77	0,76	0,78	0,84	0,84	1,00														
9 Carmignac Patrimoine A EUR Acc	0,47	0,76	0,75	0,75	0,67	0,75	0,69	0,67	1,00													
10 DJE - Zins & Dividende PA (EUR)	0,50	0,90	0,77	0,77	0,77	0,81	0,86	0,92	0,68	1,00												
11 DWS Concept Kaldemorgen EUR LC	0,37	0,89	0,87	0,86	0,71	0,86	0,76	0,88	0,68	0,86	1,00											
12 DWS Top Dividende LD	0,34	0,80	0,78	0,79	0,64	0,72	0,68	0,82	0,55	0,80	0,88	1,00										
13 Ethna-AKTIV A	0,34	0,64	0,48	0,47	0,50	0,59	0,52	0,63	0,54	0,57	0,61	0,50	1,00									
14 Frankfurter Aktienfds für Stiftungen T	0,39	0,86	0,80	0,76	0,75	0,78	0,76	0,83	0,64	0,80	0,85	0,73	0,68	1,00								
15 FvS SICAV Multiple Opportunities R	0,51	0,89	0,70	0,68	0,74	0,80	0,84	0,85	0,63	0,86	0,80	0,75	0,62	0,76	1,00							
16 JPM Global Income A (acc) EUR	0,43	0,93	0,87	0,86	0,78	0,83	0,83	0,82	0,76	0,80	0,87	0,80	0,60	0,86	0,81	1,00						
17 Kapital Plus A EUR	0,60	0,93	0,80	0,79	0,81	0,79	0,86	0,79	0,70	0,83	0,76	0,63	0,53	0,75	0,83	0,87	1,00					
18 M&G Optimal Income Fam A Acc EUR Acc	0,36	0,88	0,79	0,77	0,70	0,80	0,79	0,71	0,72	0,73	0,78	0,65	0,51	0,76	0,71	0,92	0,87	1,00				
19 Nordea 1 - Stable Return BC EUR	0,41	0,73	0,65	0,64	0,51	0,62	0,60	0,69	0,54	0,69	0,70	0,65	0,37	0,54	0,66	0,70	0,73	0,65	1,00			
20 ODDO BHF Polaris Moderate DRW EUR	0,57	0,96	0,82	0,81	0,79	0,89	0,88	0,86	0,76	0,85	0,83	0,73	0,62	0,79	0,86	0,90	0,94	0,88	0,74	1,00		
21 Sauren Global Balanced A	0,19	0,81	0,78	0,77	0,69	0,79	0,79	0,77	0,74	0,73	0,83	0,75	0,65	0,83	0,68	0,87	0,67	0,79	0,50	0,77	1,00	
22 Siemens Balanced	0,49	0,97	0,87	0,87	0,76	0,88	0,84	0,86	0,74	0,85	0,87	0,77	0,59	0,83	0,84	0,93	0,92	0,92	0,73	0,96	0,81	1,00



alphatrend Fund



Quelle: Morningstar



alphatrend Fund | Auf einen Blick

- Start: 02.2019

- Regelbasierter Strategiefonds / All-Wetter-Fonds

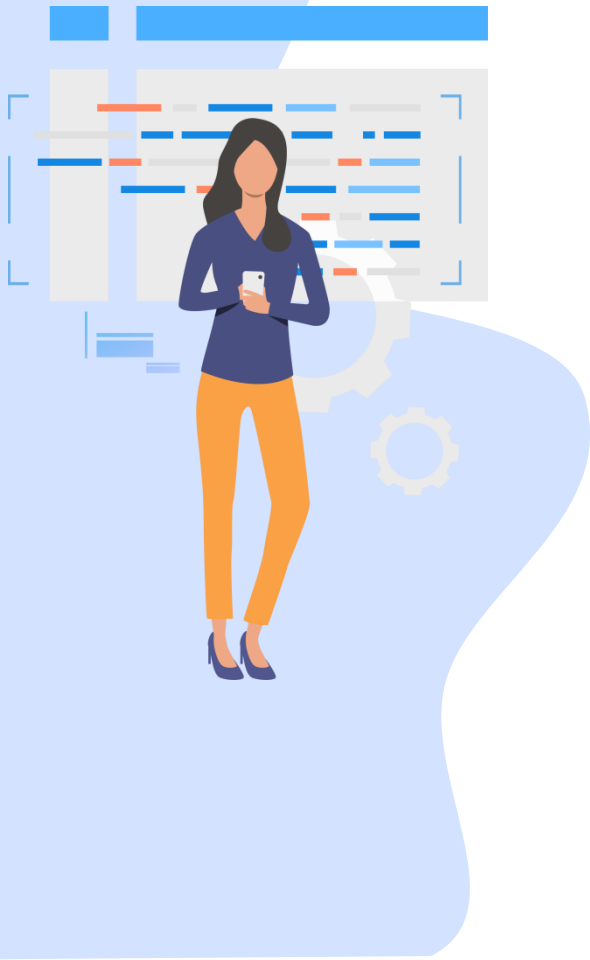
* Sehr liquide Einzelaktien und Cash mit flexibler Quote, NUR LONG

* Internationale Aktienmärkte über Indizes, LONG und SHORT

* Internationale Anleihenmärkte über Indizes, LONG und SHORT

- Attraktives Risiko-Ertrags-Profil / geringer maximaler Verlust

- Geringe Korrelationen





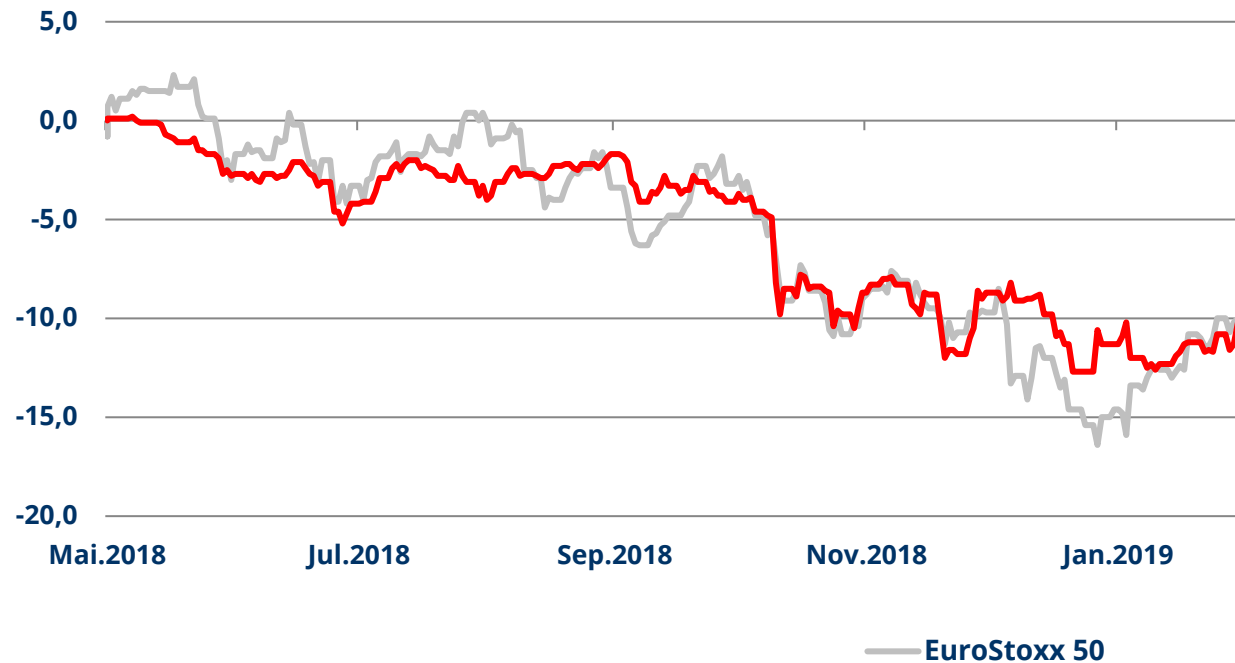
alphatrend Fund | Fondsdaten

	<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 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 | Doppelstrategie

Besonderheit: Entwicklung in der Auflagephase



Wertentwicklung in % in EUR

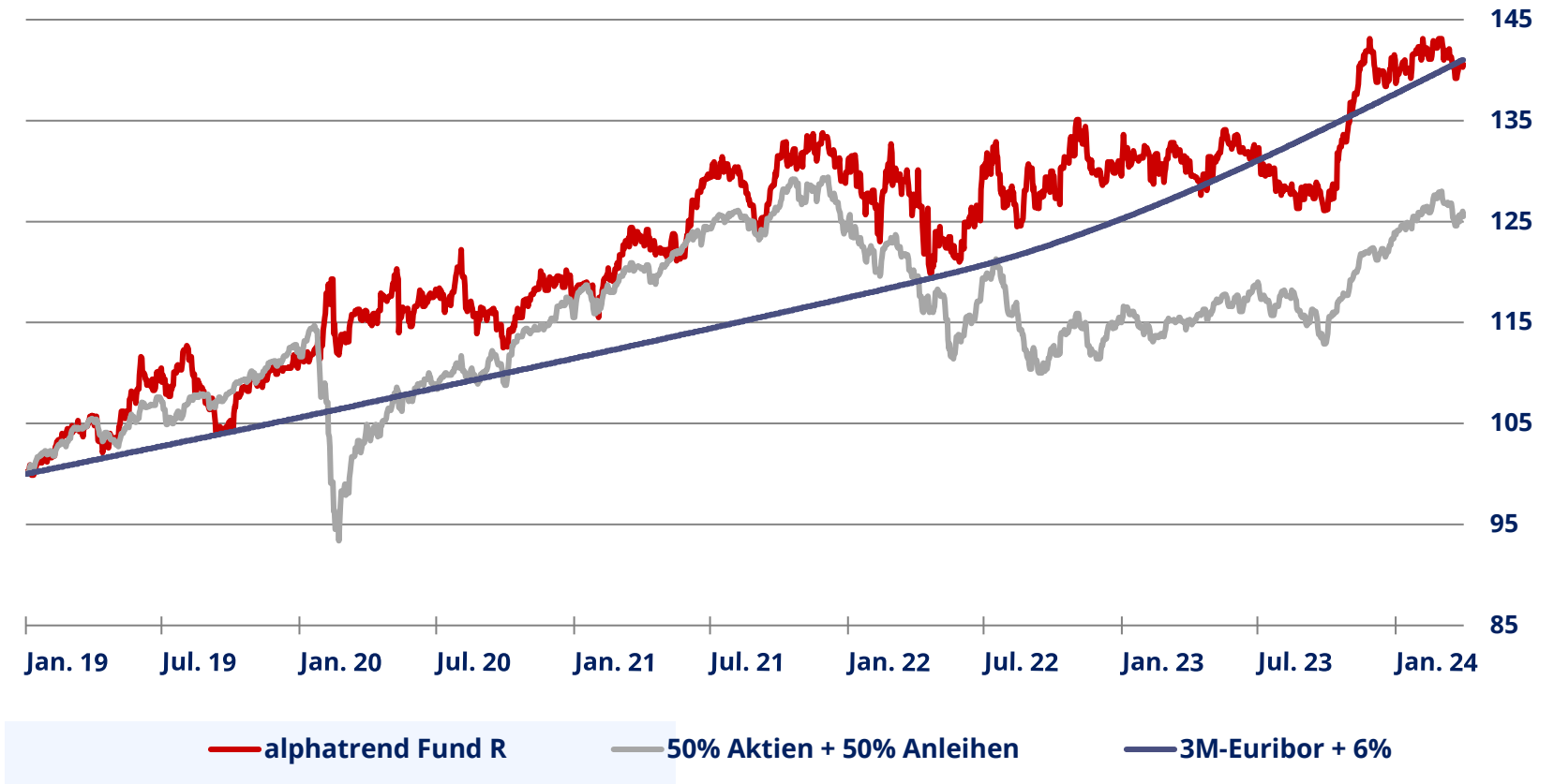
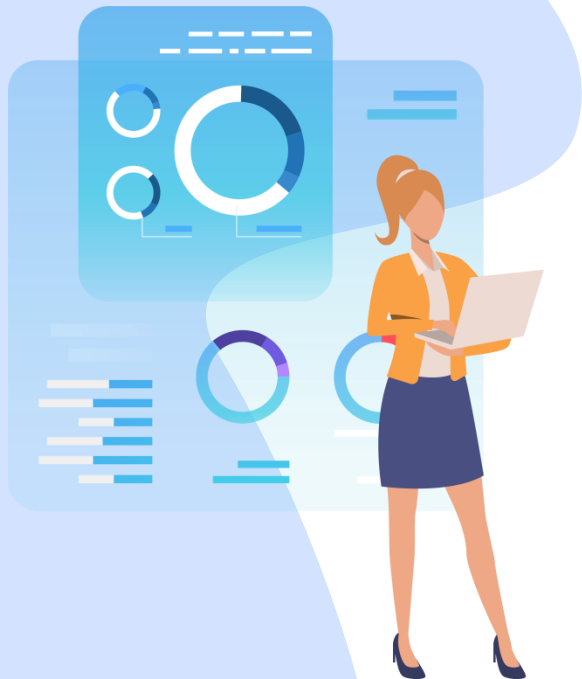
Die einzelnen Strategien des alphas trend Fund wurden ab dem Fondsstart am 23.04.2018 bis zum 04.02.2019 sukzessive implementiert. Der Fonds entwickelte sich in dieser Phase daher wie ein Aktieninvestment.

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



alphatrend Fund | Wertentwicklung

Ergebnisse seit vollständiger Integration der Strategien



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 30.04.2024



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.



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