



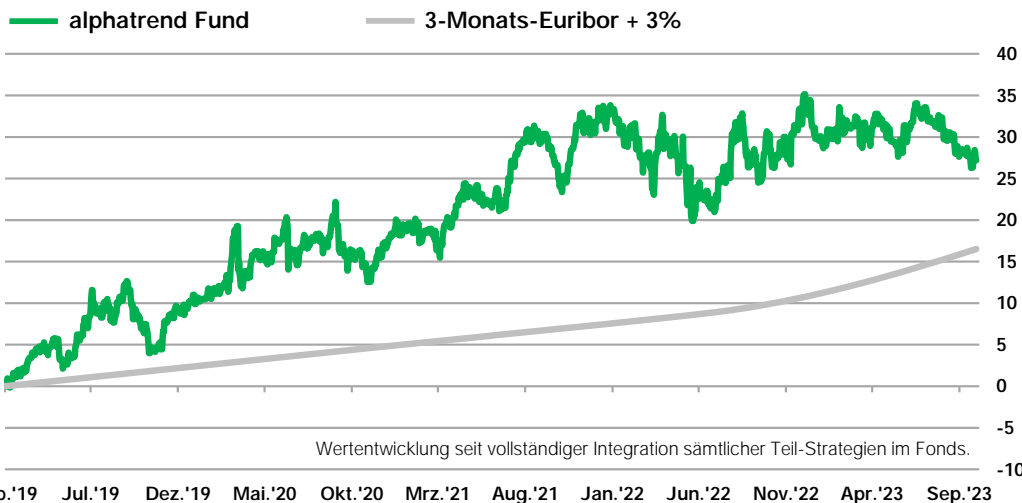
Fondsstrategie

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 Portfolioanteils geeignet.

Wertentwicklung | Chart



WKN / ISIN

A2DXW9 / 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%

Verwaltungsvergütung

bis zu 0,14% p.a.

Anlageberatervergütung

bis zu 1,07% p.a.

Vertriebsstellenvergütung

bis zu 0,60% p.a.

Verwahrstellenvergütung

bis zu 0,04% p.a.

Erfolgshonorar

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 sparplanfähig.

Mindestaktienquote

Keine

Fondsvolumen

24,95 Mio. Euro

Portfolioaufteilung

Allokation nach Anlageklassen

US-Einzelaktien 50%

Aktien-Indizes 25%*

Renten-Indizes 25%*

Strategie und Methodik

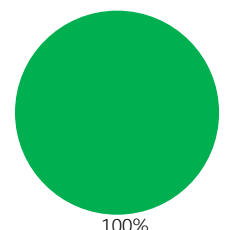
GALAXY BREAKOUT Long / Flat
CONTRARIAN Long / Flat
SWING Long / Flat

HEDGE+ BREAKOUT Long / Short
CONTRARIAN Long / Short
SWING Long / Short

HEDGE+ BREAKOUT Long / Short
CONTRARIAN Long / Short
SWING Long / Short

Trendzyklus / Investitionsdauer

DayTrading
Short Term
Long Term



* risikoadjustiert



Bericht des Anlageberaters | September

Der September machte seinem Ruf als historisch schlechtester Börsenmonat alle Ehre. Sowohl die Aktien- als auch die Rentenmärkte gaben in der Breite nach.

Mit einem Minus von 3,5% konnte sich der deutsche Aktienindex **DAX** im Vergleich zum US-amerikanischen **S&P 500** (-4,9%) noch relativ gut aus der Affäre ziehen. Auf der Rentenseite gaben deutsche Staatsanleihen gemessen am **REXP TR** im Monatsverlauf um 1,2% nach. Der internationale Staatsanleihen-Index **FTSE WGBI TR** verlor auf Monatsicht auf USD-Basis um 3,2%.

Anleger aus dem Euroraum konnten – sofern entsprechend positioniert – von der Stärke des **US-Dollar** gegenüber dem Euro profitieren. Der **US-Dollar** legte gegenüber der europäischen Gemeinschaftswährung um 2,5% zu. Die Feinunze **Gold** verlor im September gut 5% und konnte als vermeintliche Krisenwährung nicht von dem schwierigen Umfeld profitieren.

Der **alphatrend Fund** blieb von den Unsicherheiten an den Märkten weitestgehend unbeeindruckt und hielt sich nahezu den gesamten Monat in positivem Terrain auf. Am letzten Handelstag ließen es sich die Märkte mit einem sehr volatilen Monatsausklang allerdings nicht nehmen, den Fonds doch noch leicht ins Minus zu drücken.

Die beiden im Fonds zum Einsatz kommenden Handelssysteme **GALAXY** und **HEDGE+** entwickelten sich im September gegenläufig. **GALAXY**, welches eine **LONG/FLAT**-Systematik in den wichtigsten internationalen Aktien verfolgt, erzielte – in Anbetracht der schwächelnden Aktienmärkte nachvollziehbar – mit -2,15% einen negativen Ergebnisbeitrag für den Fonds.

HEDGE+ verbuchte mit seiner **LONG/SHORT**-Systematik in den wichtigsten internationalen Aktien- und Rentenindizes hingegen einen positiven Ergebnisbeitrag und legte um 1,83% zu.

Per Saldo beendete der **alphatrend Fund** den September mit einem Ergebnis von -0,32%.

Die Märkte im September

AKTIEN:

Euro Stoxx 50 - 2,85% in EUR
S&P 500 - 4,87% in USD

RENTEN:

REXP TR - 1,16% in EUR
FTSE WGBI TR - 0,81% in EUR

WÄHRUNGEN:

USD +2,51% in EUR
YEN +0,01% in EUR

ROHSTOFFE:

Öl (Brent) +9,73% in USD
Gold -5,08% in USD

VOLATILITÄT:

VIX (CBOE) +29,1% in USD

Wertentwicklung | Jahresergebnisse

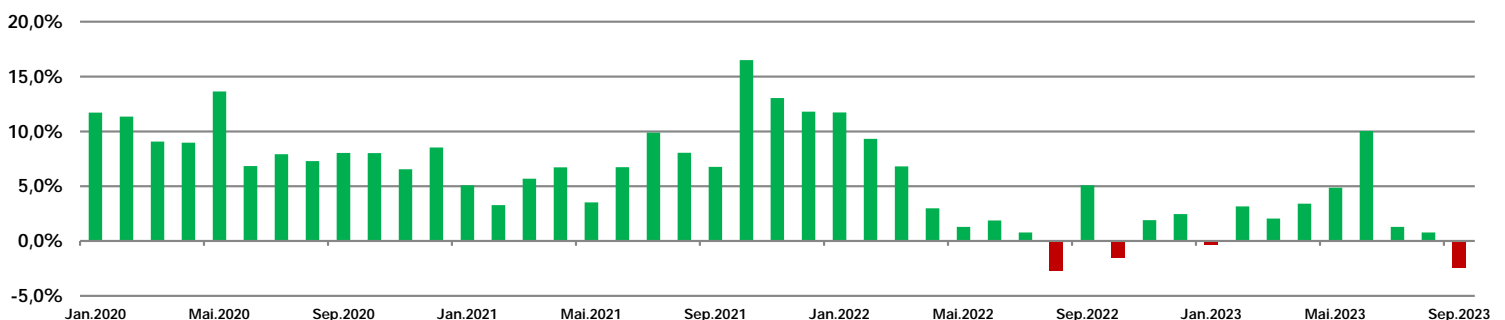
	Jan	Feb	Mrz	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	Gesamt
2023	+0,53%	+0,38%	-0,04%	-0,18%	-1,21%	+3,19%	-1,08%	-3,38%	-0,32%				-2,20%
2022	-1,62%	-3,02%	+1,05%	-1,49%	-2,59%	-1,84%	+7,46%	-2,89%	+2,93%	-0,61%	+3,71%	-3,17%	-2,46%
2021	-1,57%	-0,87%	+3,43%	+2,17%	-0,96%	+1,54%	+4,62%	+0,59%	-4,71%	+6,01%	+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	---	+1,19%	+3,18%	+1,27%	-2,11%	+4,76%	+0,60%	+2,91%	-4,24%	-2,84%	+4,78%	+0,42%	+9,90%

Rendite in % p.a.: +5,30% | Maximaler Verlust: -10,40% | Längste Verlustphase: 11,0 Monate

Sämtliche Ergebnisse und Kennzahlen verstehen sich seit vollständiger Integration sämtlicher Teil-Strategien im Fonds am 04.02.2019

Rollierende 12-Monatsergebnisse

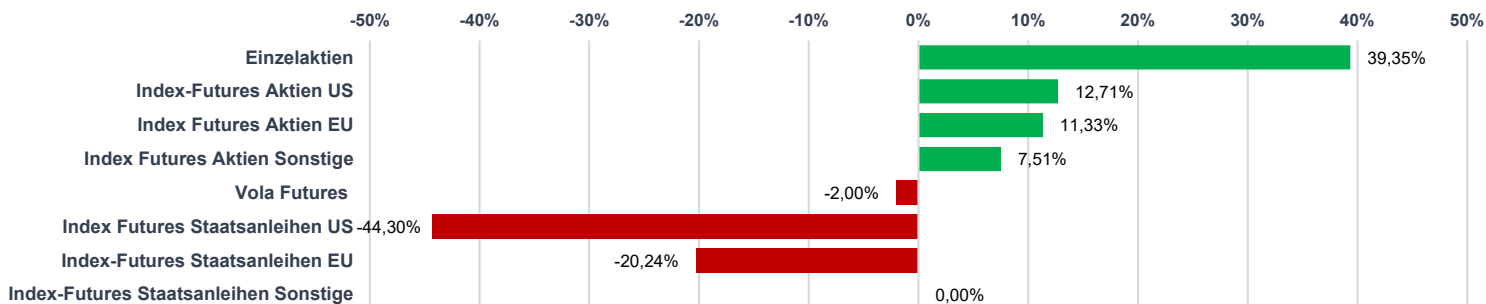
Dargestellt werden die Ergebnisse sämtlicher rollierender 12-Monatsperioden.



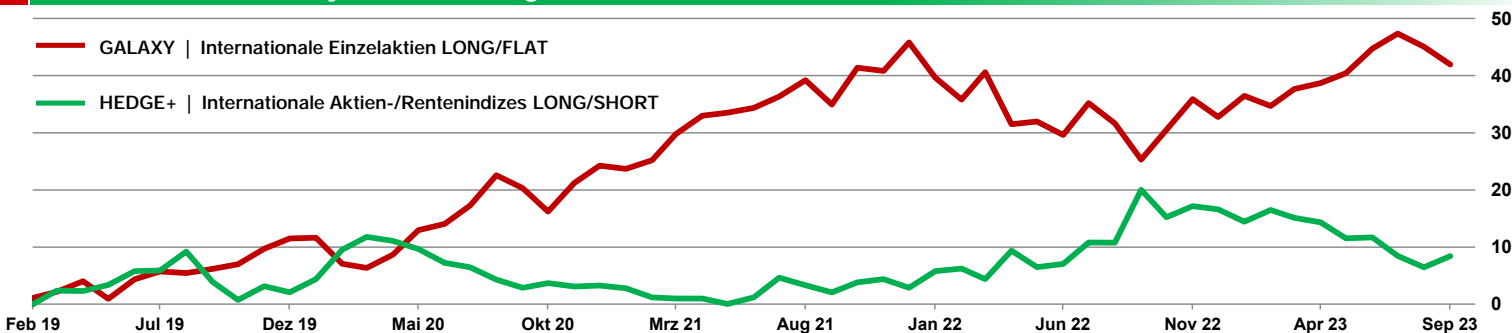
Quelle: Morningstar | Prometheus. Alle Angaben verstehen sich per Stand 30. September 2023.



Portfolio Breakdown per 30.09.2023 | Long/Short-Positionierung



Die beiden Handelssysteme im Vergleich



Die hier dargestellten Ergebnisse der beiden im Fonds eingesetzten Handelssysteme GALAXY und HEDGE+ berücksichtigen sämtliche Transaktionskosten, nicht jedoch die administrativen Fondskosten (Managementfee, Depotbankgebühr etc.). Die Darstellung verfolgt insbesondere das Ziel, die geringe Korrelation der beiden Handelssysteme untereinander zu verdeutlichen.

Gehandelte Einzelaktien und Märkte

Einzelaktien (80 Titel)

AbbVie, Abbott Labs, Accenture, Adobe, Advanced Micro, Alibaba, Alphabet "A", Amgen, American Express, American Tower, Amazon, AON, Apple, ASML, AstraZeneca, Bank of America, Barrick Gold, Berkshire Hathaway, Boeing, Bristol Myers, Broadcom, Caterpillar, Charles Schwab, Chevron, Cisco, Coca Cola, Comcast, Conoco Phillips, Costco Wholesale, Danaher, Disney, Eli Lilly, ExxonMobil, Goldman Sachs, Home Depot, Honeywell, IBM, Intel, Intuit, JD.com, Johnson & Johnson, JP Morgan, Linde, Lowe's, Master Card, McDonald's, Meta Platforms, Merck, Microsoft, NextEra, Netflix, NIO, Nike, Nvidia, Oracle, Petroleo Brasileiro, PinDuoDuo, Pepsico, Pfizer, Procter & Gamble, Prologis, Qualcomm, Rio Tinto, Raytheon, Salesforce, SAP, Starbucks, Sony, S&P Global, Target, Thermo Fisher Scientific, Tesla, Texas Instruments, United Health, Union Pacific, United Parcel Service, Visa, Verizon, Wells Fargo, Walmart

Aktien-Indizes (12 Märkte)

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

Renten-Indizes (11 Märkte)

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

Risikoeinstufung

Seit dem 1. Juli 2011 müssen in der EU zum öffentlichen Vertrieb zugelassene Investmentfonds in Risikoklassen eingeteilt werden. Die Einstufung erfolgt entsprechend der Höhe der historischen Schwankungsbreite (Volatilität) des Fonds. Je höher die Risikoklassifizierung, desto höher ist das Risiko des Fonds einzustufen.



Diese Information stellt keine Anlageberatung oder sonstige Empfehlung dar, sondern ist lediglich eine zusammenfassende Kurzzusammenfassung wesentlicher Merkmale des Fonds. Alleinige Grundlage für den Kauf von Fondsanteilen des **alphatrend Fund** sind ausschließlich die aktuellen Verkaufsunterlagen. Hierzu zählen die wesentlichen Anlegerinformationen (KID), der Verkaufsprospekt, der Jahresbericht und – sofern dieser älter als acht Monate ist – der Halbjahresbericht des Fonds. Die Verkaufsunterlagen sind kostenfrei bei der Fondsgesellschaft sowie der Vertriebsgesellschaft und unter www.prometheus.de erhältlich.

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.

Quelle: Morningstar | Prometheus. Alle Angaben verstehen sich per Stand 30. September 2023.