



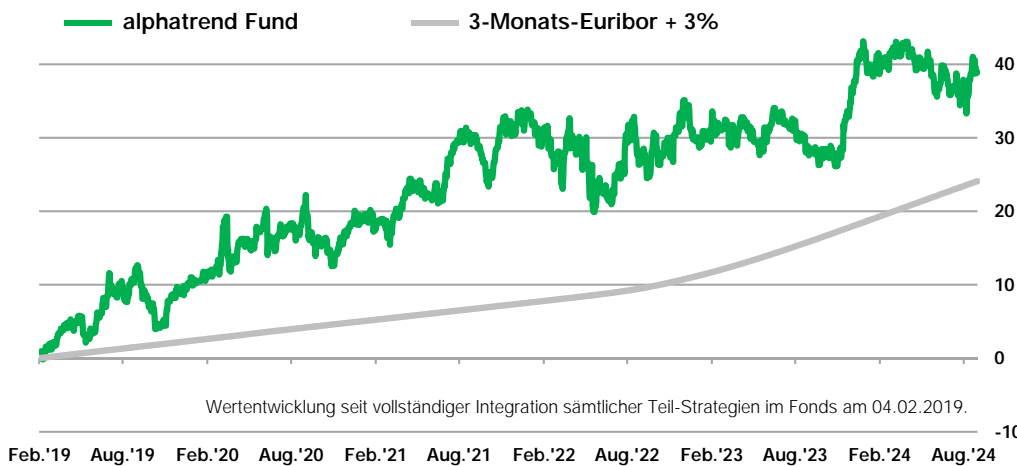
Fondsstrategie

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

23,28 Mio. Euro

Portfolioaufteilung

Allokation nach Anlageklassen

US-Einzelaktien 50%

Aktien-Indizes 25%*

Renten-Indizes 25%*

* risikoadjustiert

Strategie und Methodik

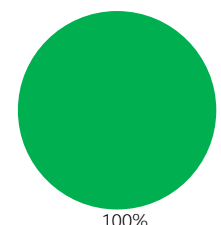
GALAXY
BREAKOUT Long / Flat
CONTRARIAN Long / Flat
SWING Long / Flat

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





Bericht des Anlageberaters | August

Der August begann an den Aktienmärkten sehr turbulent und schickte die globalen Aktienindizes zunächst auf Tauchstation. So gaben **EuroStoxx 50** und **S&P 500** in der Spitze in den ersten Handelstagen jeweils um rund 8% nach. Der japanische **Nikkei** verlor in den ersten drei Handelstagen gar rund 20% seines Wertes. Ebenso dynamisch – allerdings in die für Anleger bevorzugte Richtung – setzen die internationalen Aktienmärkte den Monat fort. Die Aktienindizes zeigten eine beeindruckende Erholung und konnten den Monat zumeist noch in positivem Terrain abschließen. Per Saldo beendete der **EuroStoxx 50** den August mit einem Plus von 1,75%. Der **S&P 500** legte auf US-Dollar-Basis um 2,28% zu. Für Anleger aus dem Euroraum sorgte allerdings der gegenüber dem Euro schwächelnde US-Dollar für ein Nullsummenspiel. Der **Greenback** wertete gegenüber der europäischen Gemeinschaftswährung um 2,24% ab.

Auf der Rentenseite gingen die Renditen leicht zurück, sodass die Anleihenurse tendenziell zulegten. So gewann der deutsche Rentenindex **REXP TR** auf Monatsicht 0,77% hinzu. Der internationale Staatsanleihenindex **WGBI TR** beendete den Monat auf US-Dollar-Basis mit +2,30%. Allerdings bremste Euro-Anleger auch hier der US-Dollar aus. Ähnliches galt für Goldinvestoren. Die Feinunze stieg auf US-Dollar-Basis zwar um 2,21%, blieb für Euro-Anleger im August aufgrund der US-Dollar-Schwäche allerdings ohne Performance-Beitrag.

Der **alphatrend Fund** beendete den Monat mit einem Plus von 0,76%.

Während das Handelssystem HEDGE+ mit seiner kurzfristig orientierten LONG/SHORT-Systematik in den wichtigsten internationalen Aktienindex- und Rentenindex-Futures mit +1,44% einen positiven Ergebnisbeitrag beisteuern konnte, tat sich das Handelssystem GALAXY mit seiner systematischen LONG/FLAT-Strategie in den wichtigsten internationalen Einzelaktien im August schwer. Insbesondere während der sehr dynamischen Trendwende im ersten Monatsdrittel verlor GALAXY etwas den Anschluss. Per Saldo verblieb für GALAXY mit -0,69% ein negativer Ergebnisbeitrag. Derartige Monate zeigen jedoch, wie gut sich die beiden Fondskomponenten ergänzen und insgesamt für eine unaufgeregte und konstante Wertentwicklung des Fonds sorgen.

Obwohl der **alphatrend Fund** mittlerweile 5 der 8 abgelaufenen Monate des Jahres mit einem positiven Monatsergebnis beenden konnte, liegt der Fonds per Saldo im Kalenderjahr 2024 mit -2,00% noch leicht im Hintertreffen. Grund hierfür ist, dass die positiven Monate im laufenden Jahr bis dato etwas Dynamik vermissen ließen. Positive Dynamik zeigt der Fonds erfahrungsgemäß und nachvollziehbarer Weise in Phasen, in denen beide Handelssysteme gleichzeitig erfolgreich agieren.

Wertentwicklung | Monats- und Jahresergebnisse

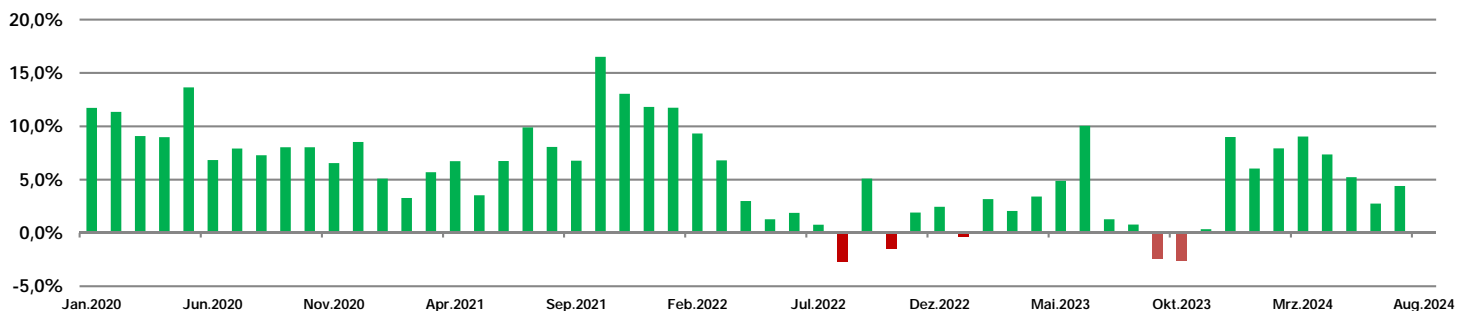
	Jan	Feb	Mrz	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	Gesamt
2024	-2,19%	+2,18%	+0,98%	-1,73%	-3,17%	+0,76%	+0,52%	+0,76%					-2,00%
2023	+0,53%	+0,38%	-0,04%	-0,18%	-1,21%	+3,19%	-1,08%	-3,38%	-0,32%	-0,81%	+6,82%	+5,17%	+8,99%
2022	-1,62%	-3,02%	+1,05%	-1,49%	-2,59%	-1,84%	+7,46%	-2,89%	+2,93%	-0,61%	+3,71%	-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.: +6,02% | Maximaler Verlust: -10,40% | Längste Verlustphase: 12,0 Monate

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

Rollierende 12-Monatsergebnisse

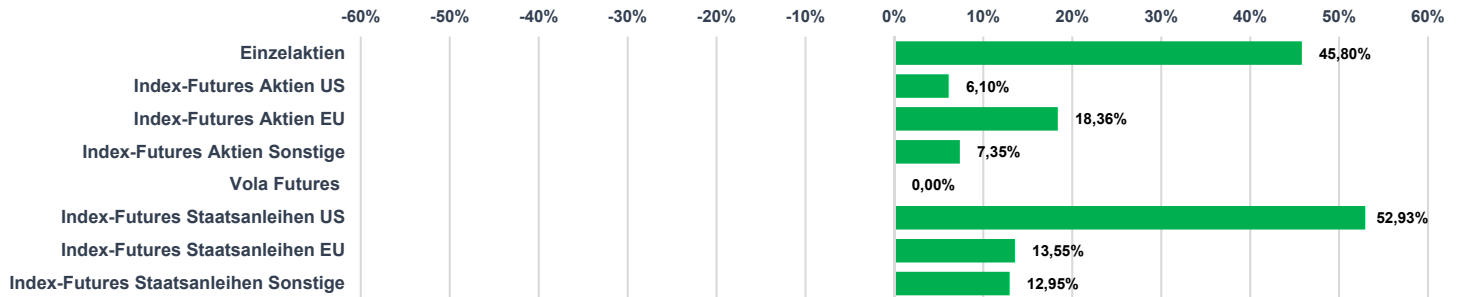
Dargestellt werden die Ergebnisse sämtlicher rollierender 12-Monatsperioden.



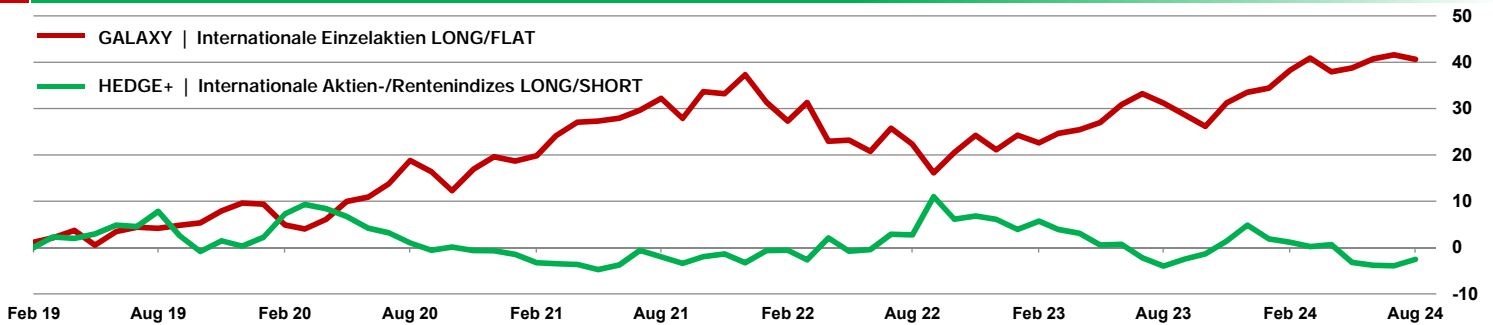
Quelle: Morningstar, Prometheus. Sämtliche Ergebnisse und Kennzahlen verstehen sich seit vollständiger Integration sämtlicher Teil-Strategien im Fonds am 04.02.2019 | Stand: 31. August 2024



Portfolio Breakdown per 31.08.2024 | Long/Short-Positionierung



Die beiden Handelssysteme im Vergleich



In den hier dargestellten Ergebnissen der beiden im Fonds eingesetzten Handelssysteme GALAXY und HEDGE+ sind sämtliche Fondskosten berücksichtigt. 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 Kurzdarstellung 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 31. August 2024.