



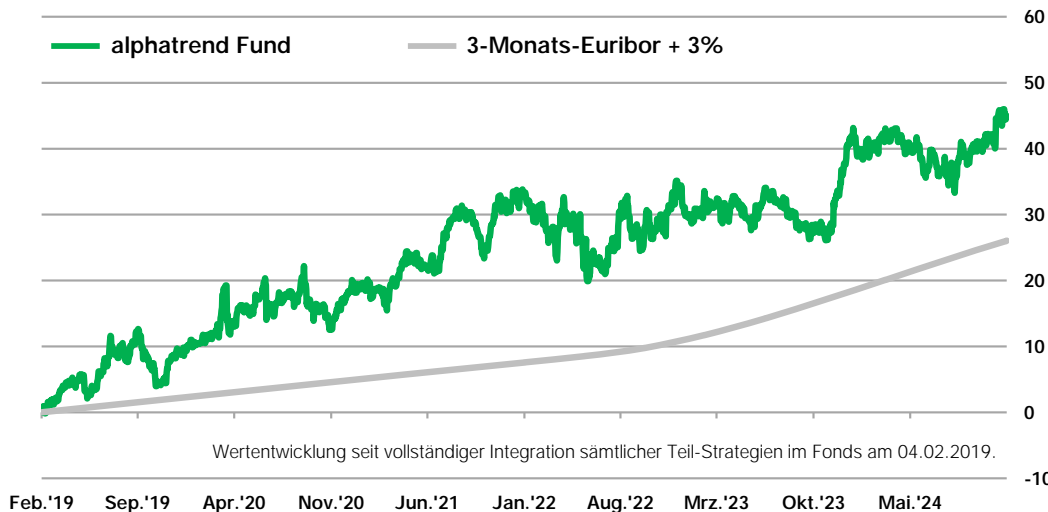
Fondsstrategie

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

Anteilsklasse R: A2DXW9 | LU1687250271
Anteilsklasse I: A3C6ZS | LU2406613492

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

23,76 Mio. Euro

Portfolioaufteilung

Allokation nach Anlageklassen

US-Einzelaktien 50%

Aktien-Indizes 25%*

Renten-Indizes 25%*

Strategie und Methodik

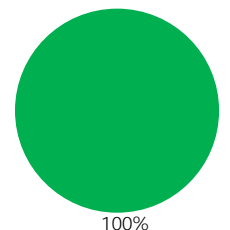
GALAXY BREAKOUT Long / Flat
CONTRARIAN Long / Flat
SWING Long / Flat

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 | November

Im November entwickelten sich sowohl die Aktien- als auch die Rentenmärkte überwiegend positiv. Auf der Aktienseite zeigten sich insbesondere die US-Indizes von ihrer Schokoladenseite. Der marktbreite **S&P 500** (+5,7%) und der Technologie-Index **Nasdaq** (+5,2%) legten deutlich zu. Anleger aus dem Euroraum konnten sich bei ihren US-Investments zudem über die Stärke des **US-Dollar** gegenüber dem Euro freuen. Der Greenback legte im Monatsverlauf um 2,8% zu und vergoldete für europäische Investoren somit die Kursgewinne bei US-Aktien. Nicht ganz so gut lief es hingegen für europäische Aktien. Zwar konnte der deutsche **DAX** um 2,9% zulegen, der **Euro Stoxx 50** gab im November allerdings um 0,5% nach. Grund hierfür war der schwächelnde französische Aktienmarkt, der im November – gemessen am **CAC 40** – aufgrund der derzeit schwierigen politischen Gemengelage in Frankreich 1,6% verlor. Französische Aktien machen im **EuroStoxx 50** einen Anteil von rund 37% aus.

Auf der Rentenseite sorgten rückläufige Zinsen für einen mit +1,7% recht deutlichen Anstieg beim deutschen Rentenindex **REXP TR**. Mit einem Plus von 3,0% beim **FTSE WGBI TR** legten auch internationale Staatsanleihen auf Euro-Basis deutlich zu. Der Index profitierte neben den im November rückläufigen Zinsen insbesondere auch von der Stärke vieler wichtiger Währungen gegenüber dem Euro (YEN +4,3%, USD +2,8%, GBP +1,6%, CHF +0,9%).

Der **alphatrend Fund** konnte im November ebenfalls überzeugen.

Die beiden im Fonds zum Einsatz kommenden Handelssysteme **GALAXY** und **HEDGE+** entwickelten sich dabei allerdings unterschiedlich erfolgreich. Während **HEDGE+** mit seiner kurzfristig orientierten **LONG/SHORT**-Systematik in den wichtigsten internationalen Aktienindex- und Rentenindex-Futures einen leicht negativen Ergebnisbeitrag von -0,30% verzeichnete, konnte **GALAXY** mit seiner systematischen **LONG/FLAT**-Strategie in den wichtigsten internationalen Einzelaktien mit +3,27% einen deutlich positiven Impuls setzen.

Insgesamt beendete der **alphatrend Fund** den November mit einem Ergebnis von +2,97%. Der Fonds konnte im Monatsverlauf ein neues Allzeithoch beim Fondspreis erreichen.

Wertentwicklung | Monats- und Jahresergebnisse

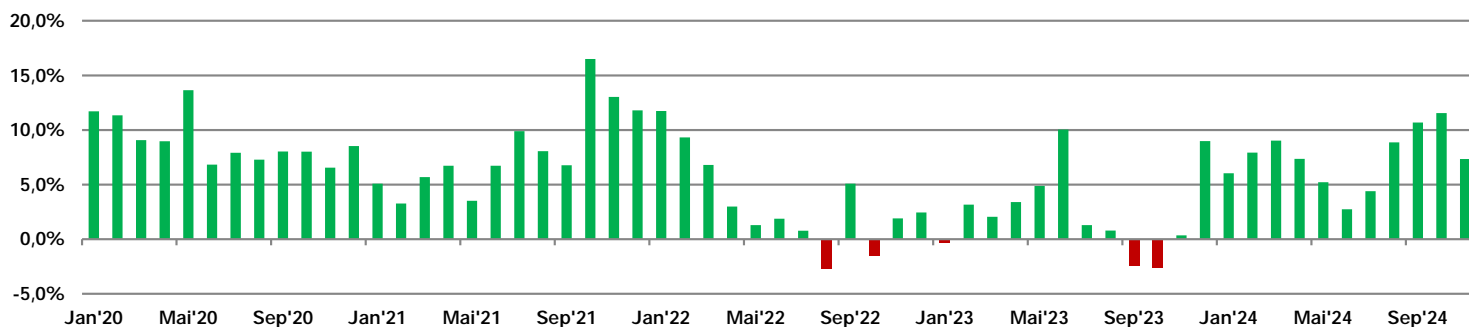
	Jan	Feb	Mrz	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	Gesamt
2024	-2,19%	+2,18%	+0,98%	-1,73%	-3,17%	+0,76%	+0,52%	+0,76%	+1,34%	-0,02%	+2,97%		+2,24%
2023	+0,53%	+0,38%	-0,04%	-0,18%	-1,21%	+3,19%	-1,08%	-3,38%	-0,32%	-0,81%	+6,82%	+5,17%	+8,99%
2022	-1,62%	-3,02%	+1,05%	-1,49%	-2,59%	-1,84%	+7,46%	-2,89%	+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.: +6,57% | 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

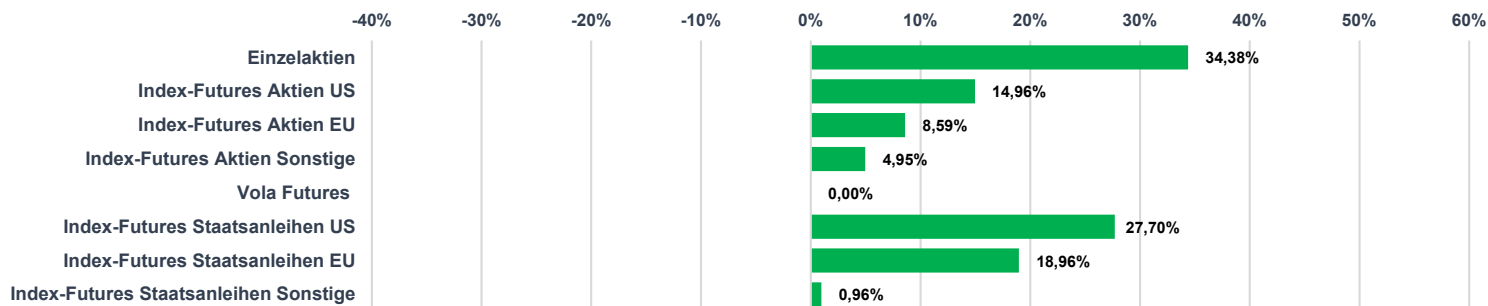
Dargestellt werden die Ergebnisse sämtlicher rollierender 12-Monatsperioden.



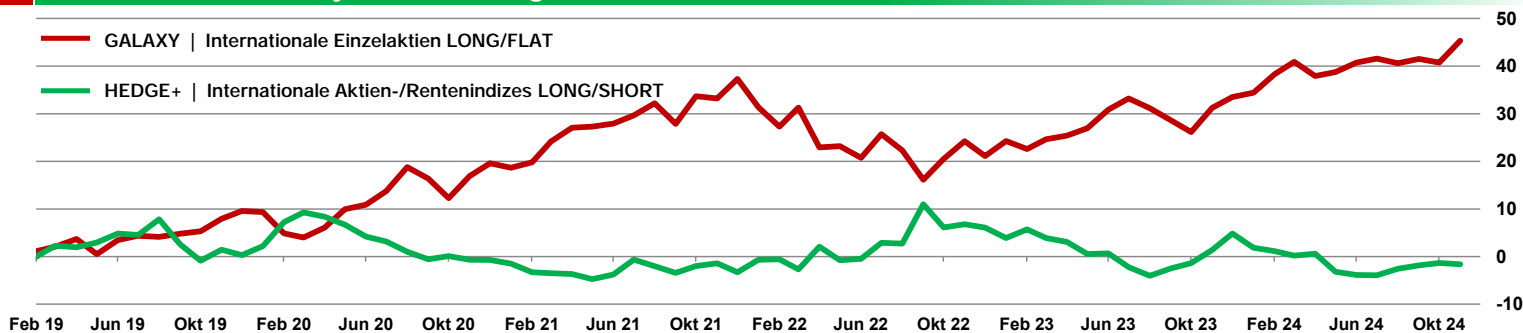
Quelle: Morningstar, Prometheus. Sämtliche Ergebnisse und Kennzahlen verstehen sich seit vollständiger Integration sämtlicher Teil-Strategien im Fonds am 04.02.2019 | Stand: 30



Portfolio Breakdown per 30.11.2024 | 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 (68 Titel)

AT&T, Abbott Labs, AbbVie, Accenture, Adobe, Advanced Micro, Alphabet, Amazon, American Express, Amgen, Apple, Applied Materials, Broadcom, Bank of America, Berkshire Hathaway, BlackRock, Caterpillar, Chevron, Cisco, Citigroup, Coca Cola, Comcast, Conoco Phillips, Costco, Eaton, Eli Lilly, ExxonMobil, GE Aerospace, Goldman Sachs, Home Depot, IBM, Intuit, Intuitive Surgical, JP Morgan, Johnson & Johnson, Linde, Lowe's, Mastercard, McDonald's, Merck & Co., Meta Platforms, Microsoft, Morgan Stanley, Netflix, NextEra Energy, Nvidia, Oracle, PepsiCo, Philip Morris, Procter & Gamble, Qualcomm, S&P Global, Salesforce, Service Now, Starbucks, Tesla, Texas Instruments, The Progressive Corp., Thermo Fisher Scientific, TJX Companies, Uber, Union Pacific, United Health, Verizon, Visa, Walmart, Walt Disney, Wells Fargo

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 **w**esentlichen **A**n**e**l**e**g**e**r**i**n**f**o**r**m**a**t**i**o**n**e**n** (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. November 2024.