

# alphatrend Fund

Der All-Wetter-Fonds | Regelbasiert. Diversifiziert.

WKN: A2DXW9  
ISIN: LU1687250271  
(Anteilklasse R)

WKN: A3C6ZS  
ISIN: LU2406613492  
(Anteilklasse I)

[www.alphatrend-fund.de](http://www.alphatrend-fund.de)



Stand: 31.01.2025

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



# LSEG Lipper Fund Awards

2024 Winner  
Germany

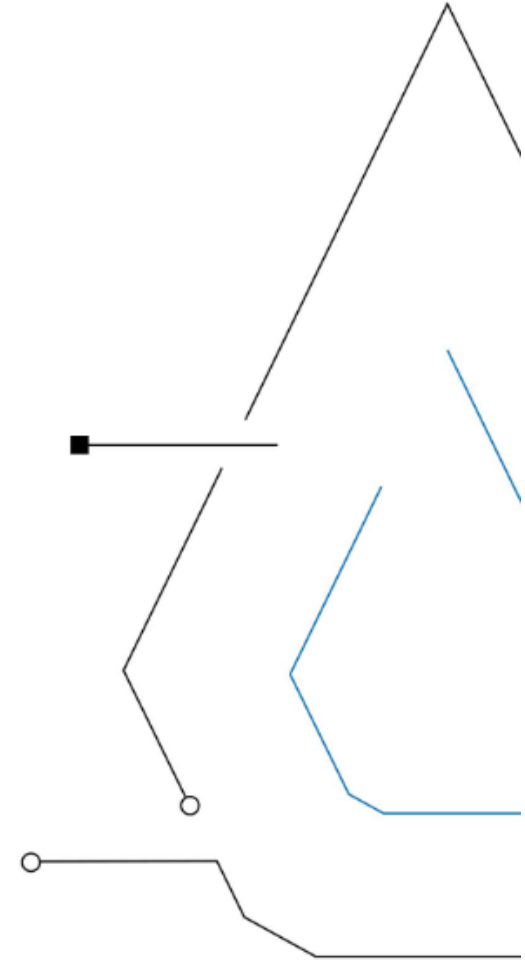
## Fundsolution Alphatrend Fund R Dis

**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

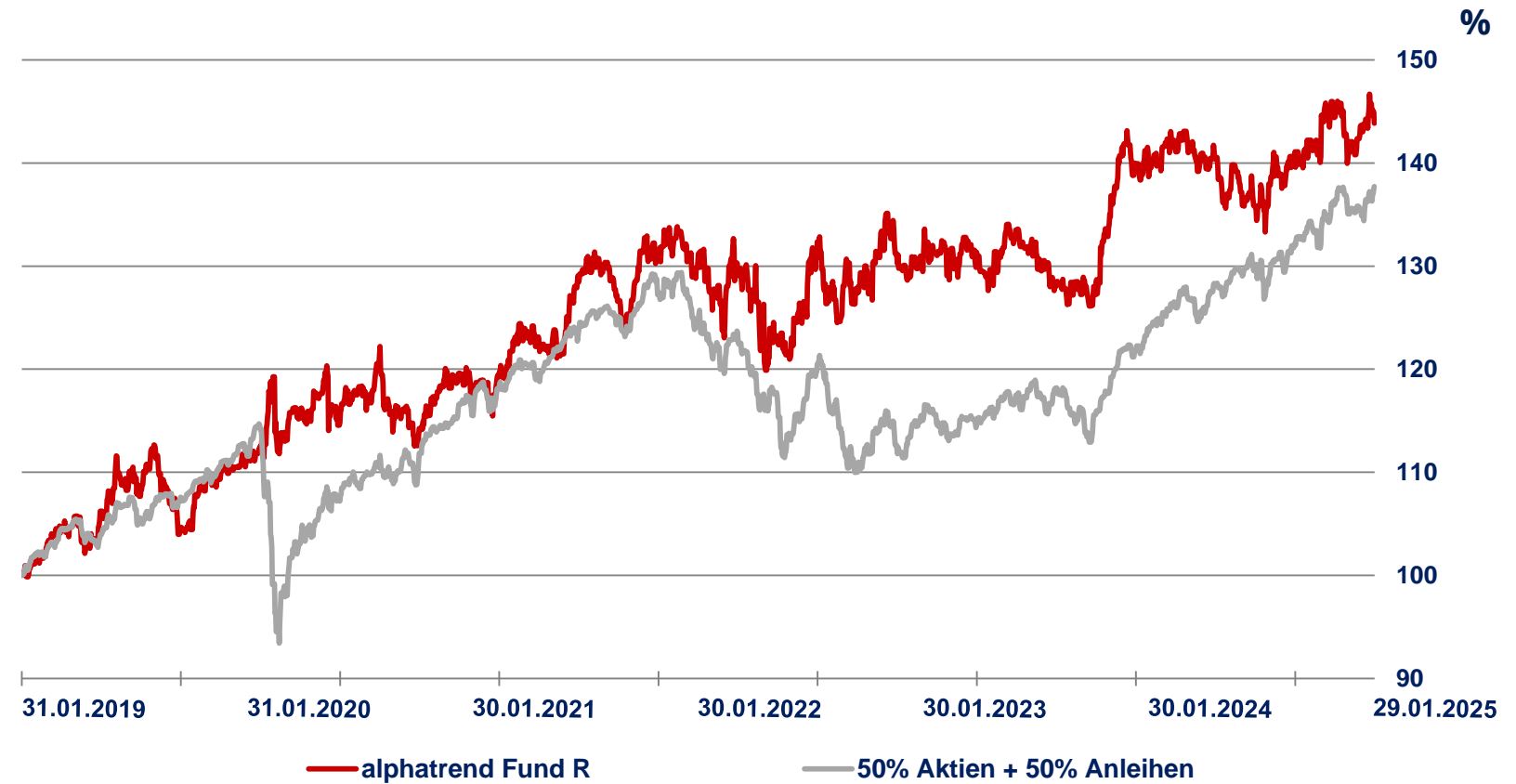


# LSEG



# alphatrend Fund | Wertentwicklung

01.02.2019 – 31.01.2025: Rendite p.a. 6,25% 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 Angaben in EUR per 31.01.2025

# 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 Rentenschonfonds, 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 logisch 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 kreierte Homepage [www.alphanthred-fund.de](http://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 André Kunze und Marc Piesch 2015 gegründete und stets inhabergeführte Prometheus-Gruppe hat ihren Sitz in Langerfeld. 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 Interessenskonflikten bei den vorgestellten Anlagen bestehen Sie bitte unseren Disclaimer auf der letzten Seite und unter [www.derfondsanalyst.de](http://www.derfondsanalyst.de)

Greiff Research Institut GmbH  
www.derfondsanalyst.de  
Tel: +49 761 76 76 0  
Fax: +49 761 76 76 20

Nr. 9 vom 15. April 2024  
Erscheinungsdatum: 14. März  
24. Jahrgang

## 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.“

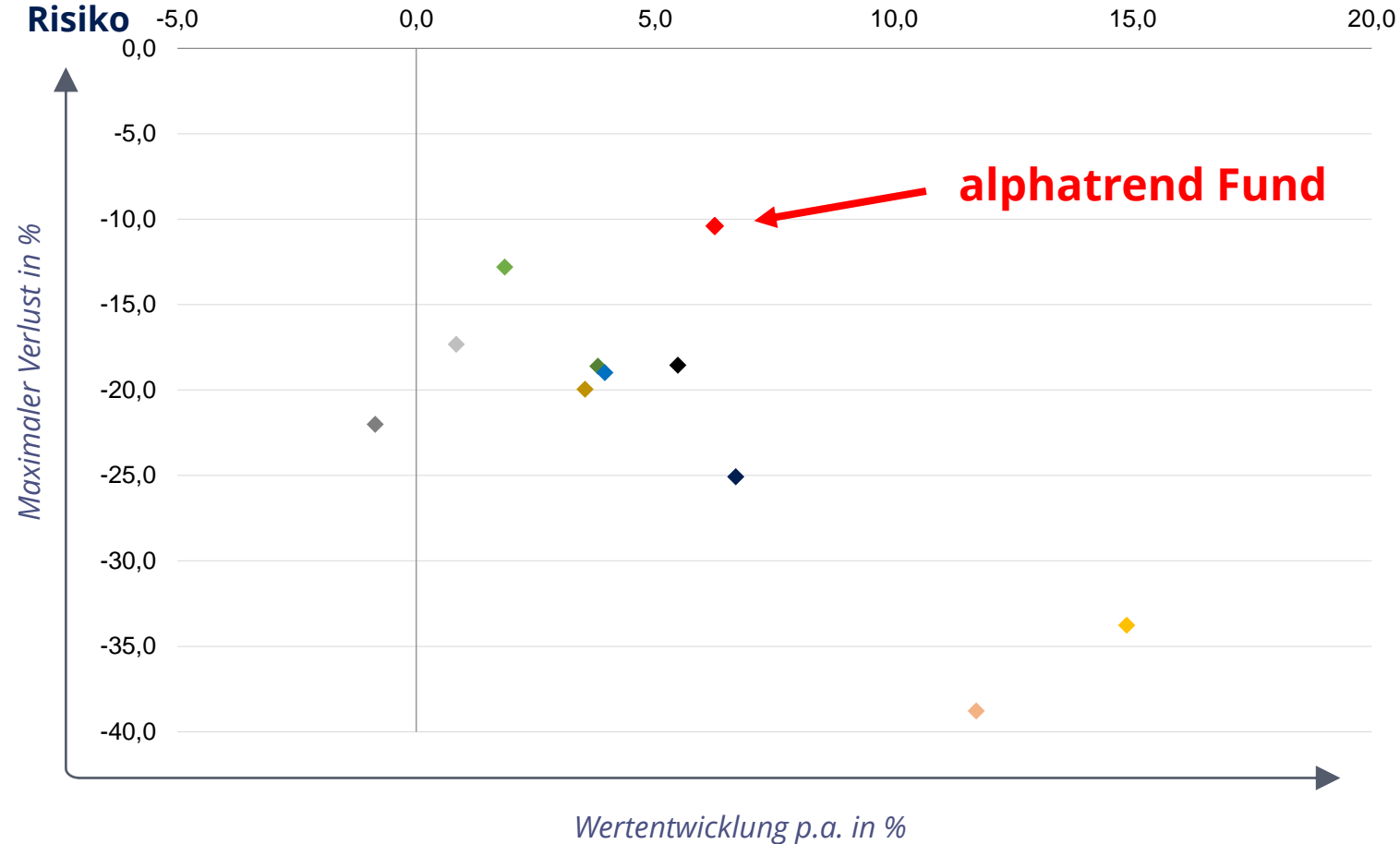




# alphatrend Fund | attraktives Risiko-Ertrags-Profil

Max. Verlust zu Wertentwicklung: 01.02.2019 – 31.01.2025

weniger  
Risiko



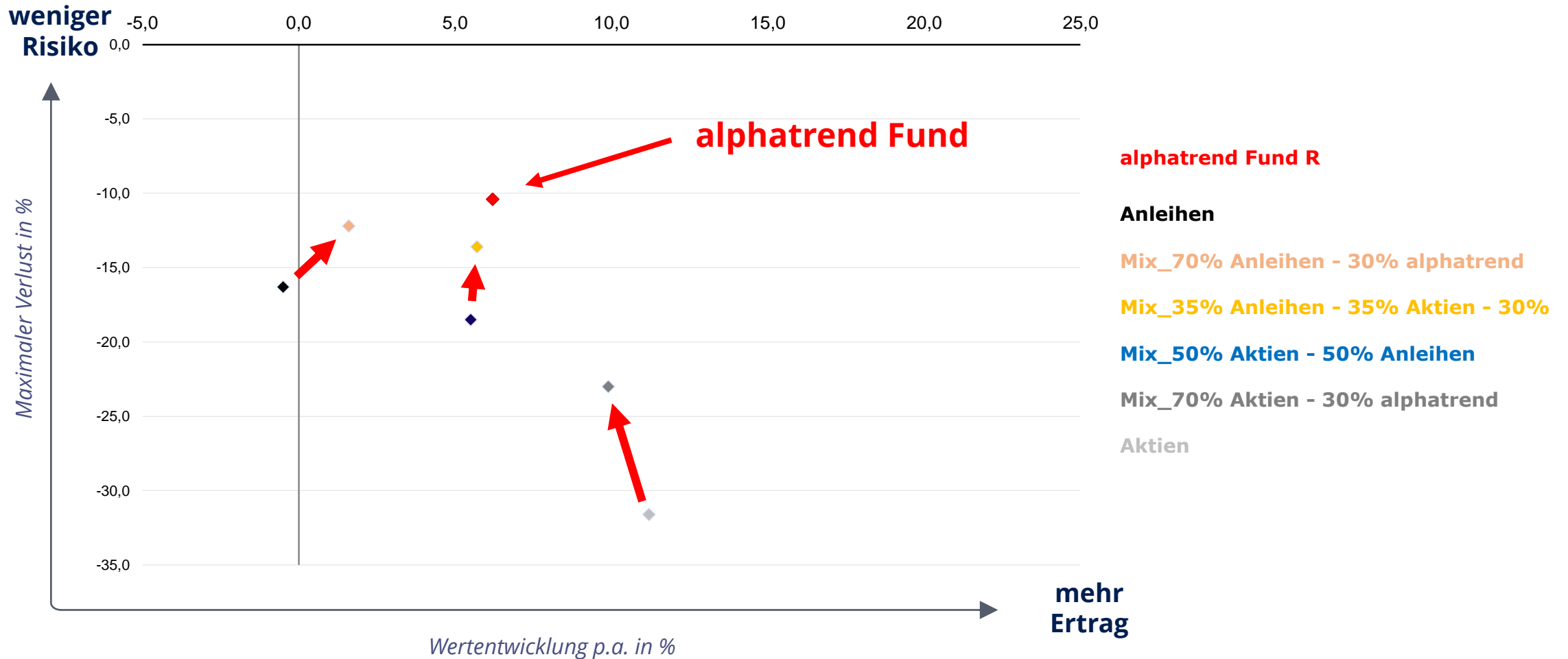
## Korrelationen

- ◆ **1,00** **alphatrend Fund R**
- ◆ **0,53** Mix\_50% Globale Aktien - 50%
- ◆ **0,41** DAX
- ◆ **0,51** MSCI World
- ◆ **0,47** Mischfonds EUR defensiv – Global
- ◆ **0,48** Mischfonds EUR ausgew. – Global
- ◆ **0,46** Mischfonds EUR flexibel – Global
- ◆ **0,48** Mischfonds EUR aggressiv – Global
- ◆ **0,46** Staatsanleihen EUR
- ◆ **0,41** Unternehmensanleihen IG EUR
- ◆ **0,33** Unternehmensanleihen HY EUR



# alphatrend Fund | Beitrag im Portfolio

Max. Verlust zu Wertentwicklung: 01.02.2019 – 31.01.2025



Anleihen = Morningstar-Kategorie-Durchschnitt Anleihen Global EUR-hedged  
Aktien = Morningstar-Kategorie-Durchschnitt Aktien weltweit Standardwerte Blend  
Quelle: Morningstar | Alle Angaben in EUR



## 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
GALAXY 50%	Einzelaktien	LONG/FLAT	Ø 53%
	Aktien-Indizes		
HEDGE+ 50%	Aktien-Indizes	LONG/SHORT	100%
	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.



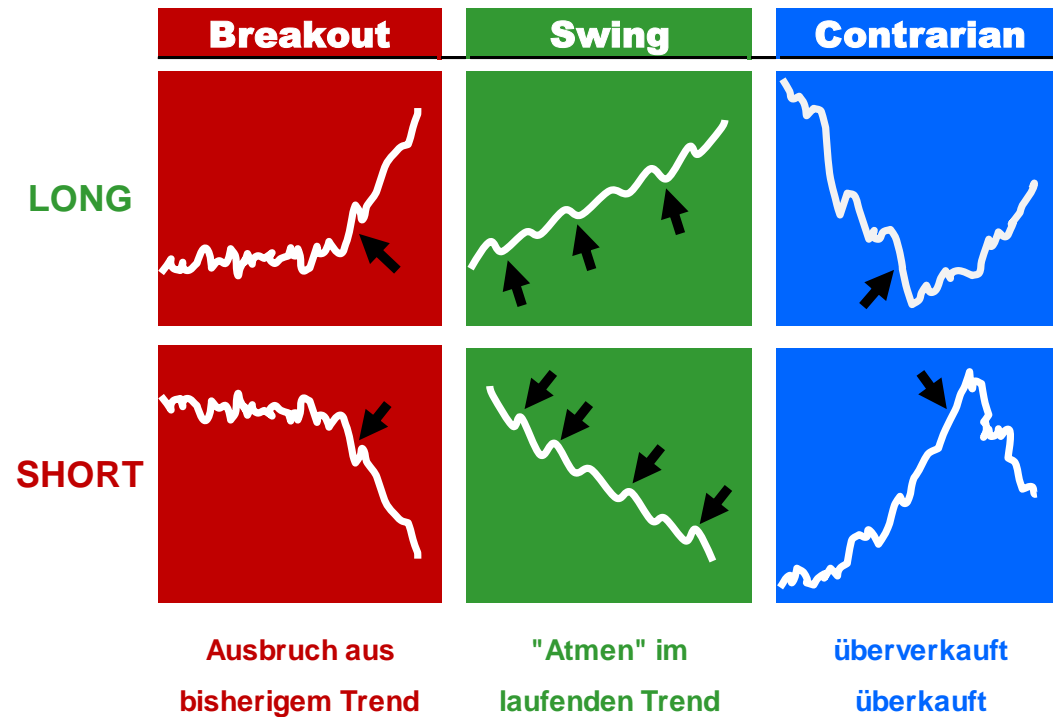
HEDGE+ investiert rein regelbasiert in die wichtigsten und liquidesten globalen Aktien- und Renten-Indizes über Futures. Es wird sowohl zyklisch als auch antizyklisch in Märkte investiert. HEDGE+ ist in den einzelnen Indizes entweder LONG (auf steigende Kurse) oder SHORT (auf fallende Kurse) ausgerichtet. 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.*

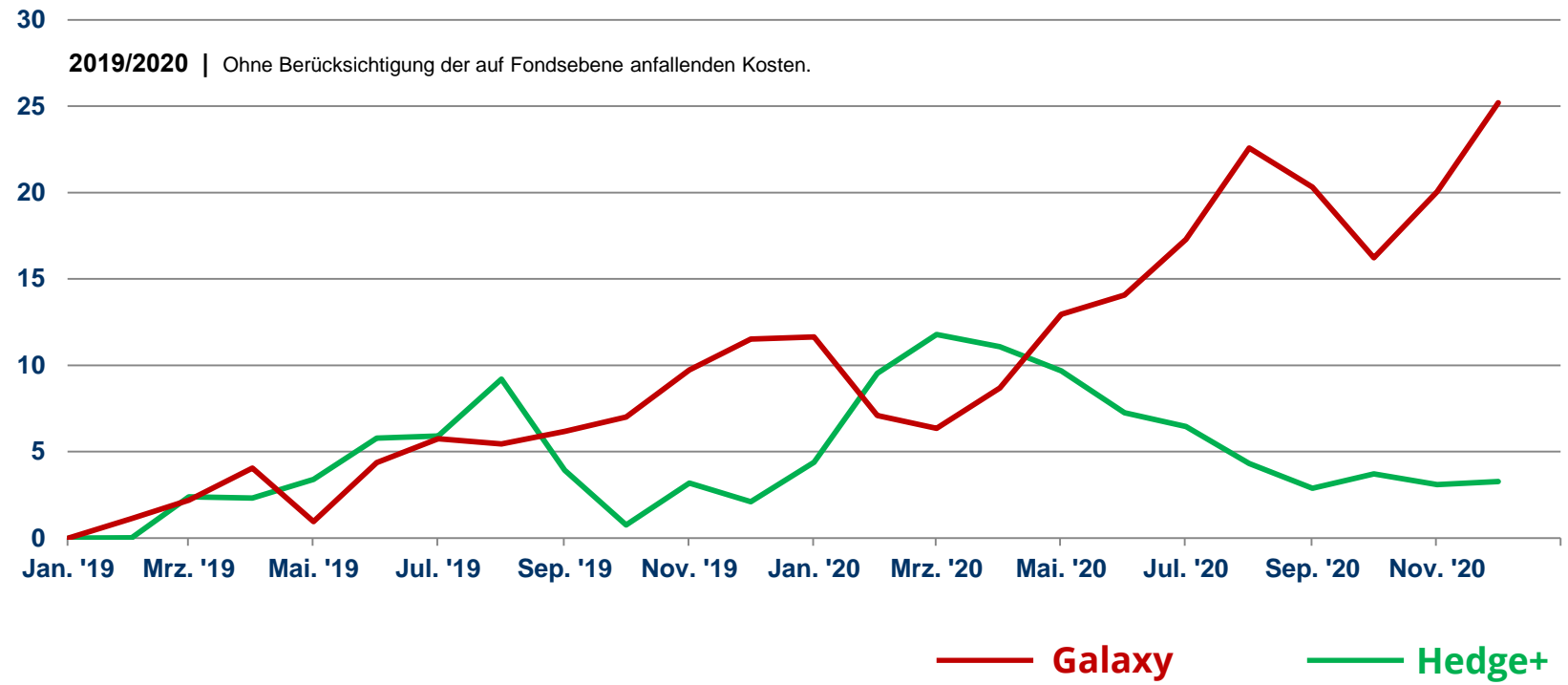




# alphatrend Fund | Doppelstrategie

*Wie wird investiert?*

## **GALAXY** | **HEDGE+**



Quelle: Prometheus | Alle Daten per 31.12.2020.



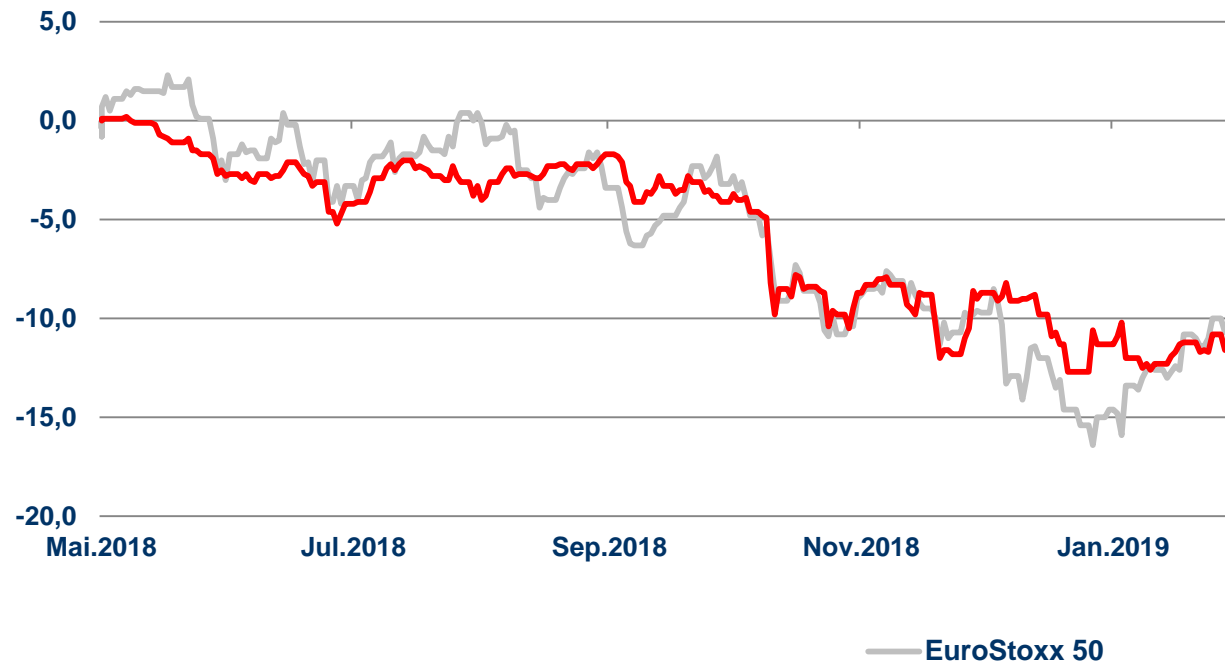
## alphatrend Fund | Fondsdaten

	<u>Anteilsklasse R</u>	<u>Anteilsklasse I</u>
<b>WKN</b>	A2DXW9	A3C6ZS
<b>ISIN</b>	LU1687250271	LU2406613492
<b>Ausgabeaufschlag</b>	bis zu 5%	0%
<b>Verwaltungsvergütung</b>	bis zu 0,14% p.a.	bis zu 0,14% p.a.
<b>Anlageberatervergütung</b>	bis zu 1,07% p.a.	bis zu 1,00% p.a.
<b>Vertriebsstellenvergütung</b>	bis zu 0,60% p.a.	0%
<b>Verwahrstellenvergütung</b>	bis zu 0,04% p.a.	bis zu 0,04% p.a.
<b>Gewinnverwendung</b>	ausschüttend	ausschüttend
<b>Mindestanlage</b>	100 Euro	100.000 Euro
<b>Performance Fee</b>	15% des Mehrertrags ggü. 3-Monats-Euribor +3% unter Berücksichtigung einer <i>High Watermark</i>	
<b>Kapitalverwaltungsgesellschaft</b>	LRI Invest S.A. Luxembourg / <a href="http://www.lri-invest.lu">www.lri-invest.lu</a>	
<b>Anlageberater</b>	P.A.M. Prometheus Asset Management GmbH	
<b>Depotbank</b>	European Depository Bank S.A. Luxembourg	



# alphatrend Fund | Doppelstrategie

*Besonderheit: Entwicklung in der Auflagephase*



Wertentwicklung in % in EUR

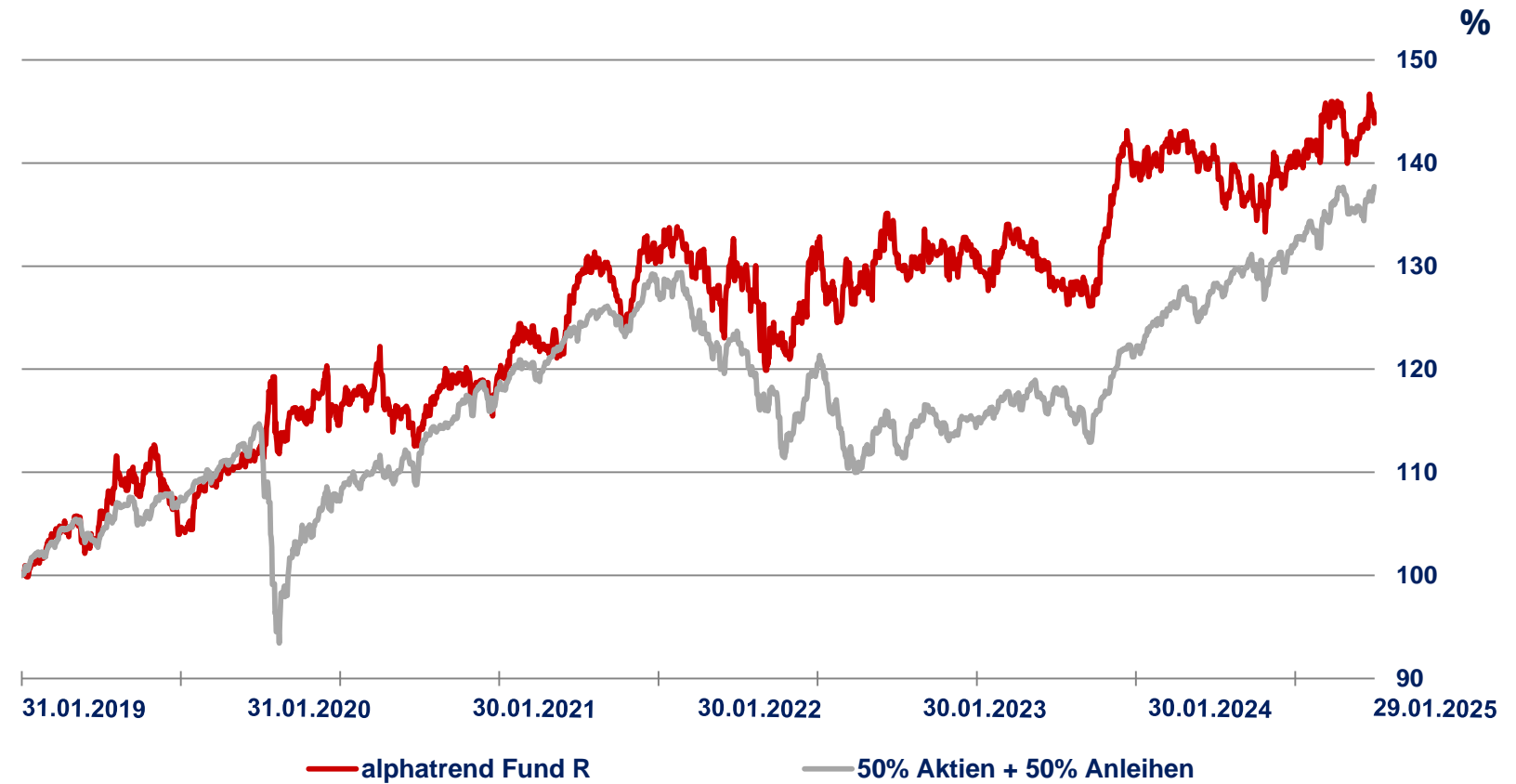
Die einzelnen Strategien des alphas trend Fund wurden ab dem Fondsstart am 23.04.2018 bis zum 04.02.2019 sukzessive implementiert. Der Fonds entwickelte sich in dieser Phase daher wie ein Aktieninvestment.

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 Angaben in EUR per 31.01.2025



# alphatrend Fund | Im Portfolio bewährt

*Beispiel: das Jahr 2022*



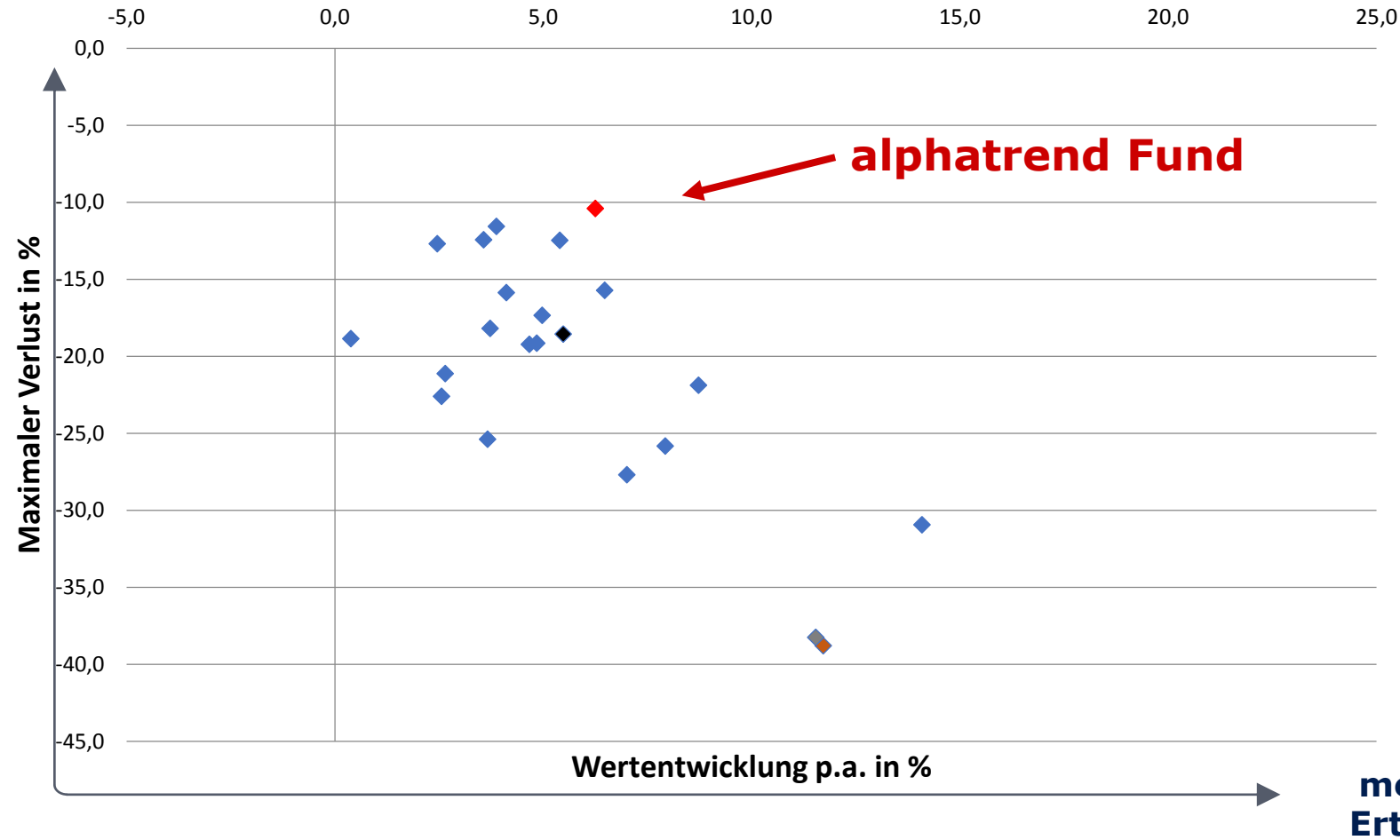
Investment	Wertentwicklung in %
<b>alphatrend Fund R</b>	<b>-2,46</b>
<b>DAX</b>	<b>-12,35</b>
<b>MSCI World</b>	<b>-12,78</b>
<b>Staatsanleihen Euro</b>	<b>-18,22</b>
<b>Unternehmensanleihen IG Euro</b>	<b>-13,65</b>
<b>Unternehmensanleihen HY Euro</b>	<b>-11,28</b>
<b>Mischfonds EUR defensiv - Global</b>	<b>-11,13</b>
<b>Mischfonds EUR ausgewogen - Global</b>	<b>-13,41</b>
<b>Mischfonds EUR flexibel - Global</b>	<b>-12,76</b>
<b>Mischfonds EUR aggressiv - Global</b>	<b>-14,71</b>



# alphatrend Fund | attraktives Risiko-Ertrags-Profil

Max. Verlust zu Wertentwicklung : 01.02.2019 – 31.01.2025

weniger  
Risiko



- ◆ **alphatrend Fund (Anteilklasse R)**
- ◆ Mix\_50% Gl. Aktien - 50% Gl. Anleihen
- ◆ DAX
- ◆ EURO STOXX 50
- ◆ ACATIS Datini Valueflex Fonds A
- ◆ Acatis 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



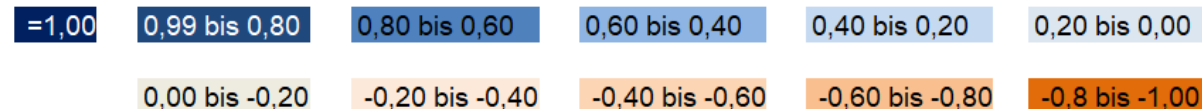


# alphatrend Fund | niedrige Korrelationen = Teamplayer

Korrelationsmatrix: 01.02.2019 – 31.01.2025

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	0,41	0,85	1,00																			
4 EURO STOXX 50	0,44	0,83	0,97	1,00																		
5 ACATIS Datini Valueflex Fonds A	0,49	0,83	0,71	0,70	1,00																	
5 Acatis Value Event Fonds A	0,43	0,90	0,81	0,80	0,75	1,00																
7 Berenberg Variato R A	0,43	0,88	0,72	0,68	0,82	0,80	1,00															
8 BGF Global Allocation A2	0,45	0,91	0,74	0,71	0,77	0,83	0,83	1,00														
9 Carmignac Patrimoine A EUR Acc	0,46	0,75	0,74	0,73	0,65	0,74	0,69	0,67	1,00													
10 DJE - Zins & Dividende PA (EUR)	0,50	0,89	0,76	0,74	0,75	0,81	0,85	0,91	0,68	1,00												
11 DWS Concept Kaldemorgen EUR LC	0,39	0,88	0,86	0,85	0,70	0,86	0,76	0,87	0,69	0,85	1,00											
12 DWS Top Dividende LD	0,35	0,79	0,77	0,77	0,62	0,71	0,68	0,80	0,56	0,78	0,87	1,00										
13 Ethna-AKTIV A	0,36	0,63	0,47	0,45	0,47	0,58	0,53	0,62	0,54	0,58	0,61	0,51	1,00									
14 Frankfurter Aktienfds für Stiftungen T	0,39	0,84	0,79	0,75	0,74	0,77	0,76	0,80	0,63	0,77	0,84	0,73	0,65	1,00								
15 FvS SICAV Multiple Opportunities R	0,51	0,87	0,70	0,68	0,71	0,79	0,84	0,83	0,64	0,85	0,80	0,74	0,63	0,75	1,00							
16 JPM Global Income A (acc) EUR	0,42	0,92	0,85	0,84	0,75	0,82	0,83	0,79	0,74	0,79	0,86	0,79	0,60	0,84	0,80	1,00						
17 Kapital Plus A EUR	0,59	0,92	0,80	0,78	0,79	0,78	0,85	0,76	0,69	0,81	0,76	0,63	0,53	0,74	0,83	0,87	1,00					
18 M&G Optimal Income Fam A Acc EUR Acc	0,37	0,87	0,77	0,74	0,67	0,79	0,78	0,69	0,69	0,71	0,76	0,63	0,51	0,74	0,70	0,92	0,86	1,00				
19 Nordea 1 - Stable Return BC EUR	0,44	0,72	0,61	0,59	0,48	0,60	0,59	0,66	0,51	0,67	0,69	0,64	0,41	0,52	0,64	0,69	0,71	0,66	1,00			
20 ODDO BHF Polaris Moderate DRW EUR	0,56	0,96	0,81	0,78	0,78	0,89	0,88	0,85	0,75	0,84	0,83	0,72	0,61	0,78	0,85	0,89	0,93	0,87	0,73	1,00		
21 Sauren Global Balanced A	0,19	0,80	0,78	0,76	0,67	0,79	0,78	0,74	0,72	0,71	0,82	0,74	0,63	0,82	0,67	0,87	0,67	0,77	0,46	0,76	1,00	
22 Siemens Balanced	0,49	0,97	0,86	0,85	0,76	0,88	0,84	0,85	0,73	0,83	0,86	0,76	0,58	0,82	0,83	0,93	0,91	0,91	0,70	0,95	0,80	1,00

alphatrend Fund





## 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

**[www.alphatrend-fund.de](http://www.alphatrend-fund.de)**





## 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](http://www.alphatrend-fund.de)***



## Kontakt

P.A.M. Prometheus Asset Management GmbH

Elisabeth-Selbert-Straße 19  
40764 Langenfeld



info@prometheus.de



02173 398 750