



# FONDSPRÄSENTATION

# **α** alphatrend **FUND**

DER ALL-WETTER-FONDS | REGELBASIERT. DIVERSIFIZIERT.

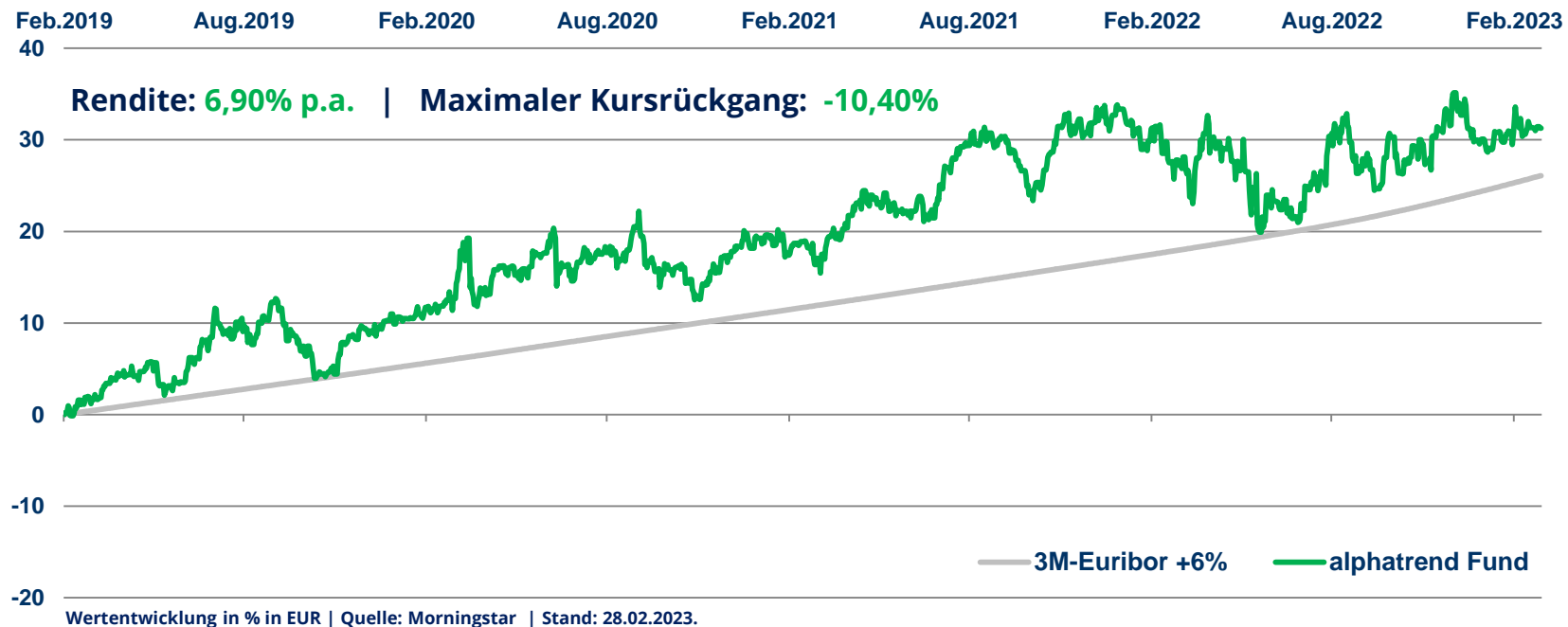
[www.alphatrend-fund.de](http://www.alphatrend-fund.de)



Diese Präsentation dient der Werbung für ein Fondsprodukt und ist nicht als Empfehlung oder Aufforderung zum Kauf zu verstehen.

Stand: 28.02.2023

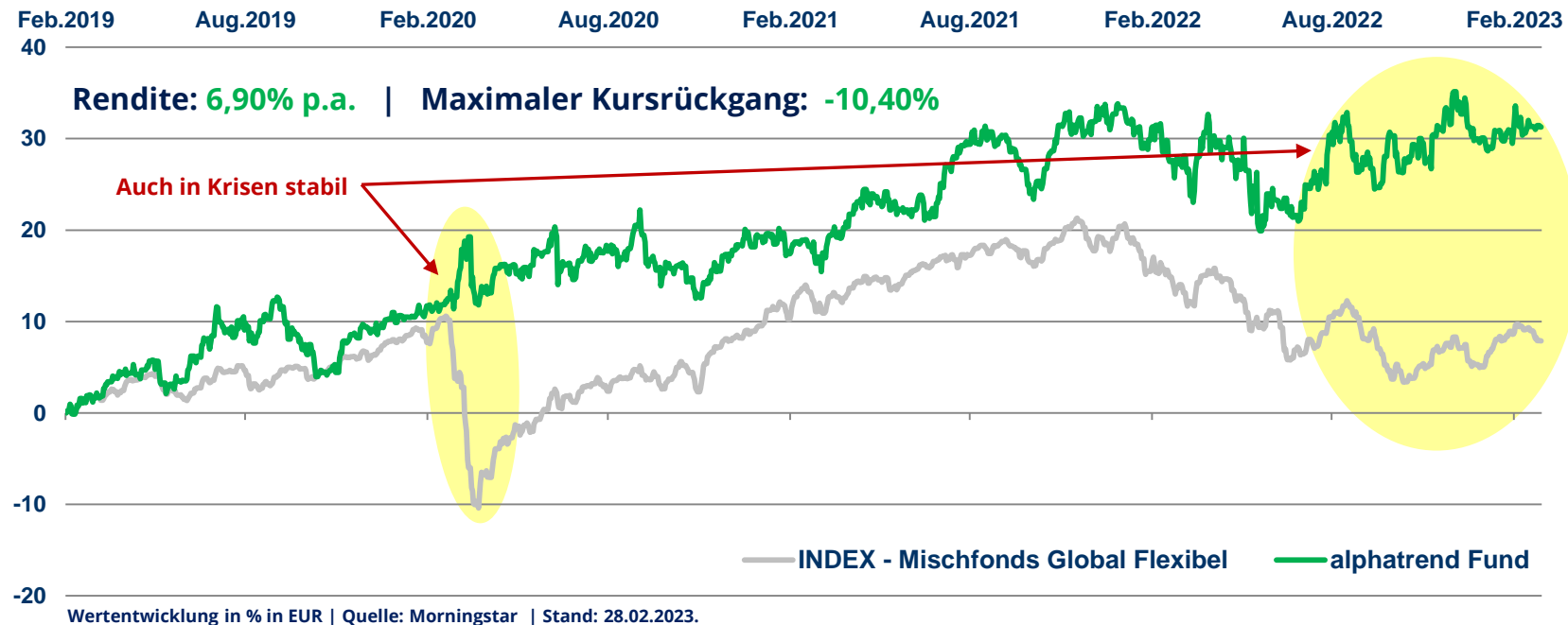
# alphatrend Fund | Wertentwicklung



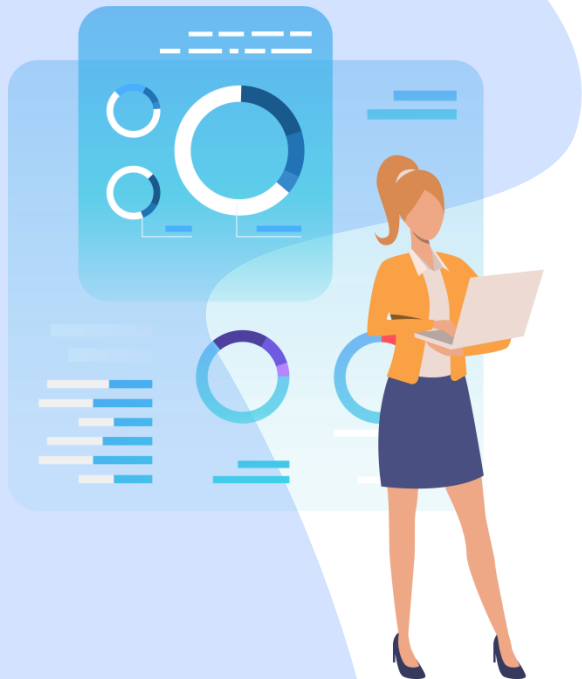
	Jan	Feb	Mrz	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	Jahr
2023	+0,53%	+0,38%											+0,92%
2022	-1,62%	-3,02%	+1,05%	-1,49%	-2,59%	-1,84%	+7,46%	-2,89%	+2,93%	-0,61%	+3,71%	-3,17%	-2,46%
2021	-1,57%	-0,87%	+3,43%	+2,17%	-0,96%	+1,54%	+4,36%	+0,59%	-4,90%	+6,01%	+0,26%	+1,18%	+11,81%
2020	+1,66%	+0,86%	+1,02%	+1,18%	+2,09%	-1,52%	+1,61%	+2,31%	-3,57%	-2,85%	+3,35%	+2,29%	+8,53%
2019	+1,29%	+1,19%	+3,18%	+1,27%	-2,11%	+4,76%	+0,60%	+2,91%	-4,24%	-2,84%	+4,78%	+0,42%	+11,31%



# alphatrend Fund | Wertentwicklung



	Jan	Feb	Mrz	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	Jahr
2023	+0,53%	+0,38%											+0,92%
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%	+4,36%	+0,59%	-4,90%	+6,01%	+0,26%	+1,18%	+11,81%
2020	+1,66%	+0,86%	+1,02%	+1,18%	+2,09%	-1,52%	+1,61%	+2,31%	-3,57%	-2,85%	+3,35%	+2,29%	+8,53%
2019	+1,29%	+1,19%	+3,18%	+1,27%	-2,11%	+4,76%	+0,60%	+2,91%	-4,24%	-2,84%	+4,78%	+0,42%	+11,31%






# alphatrend Fund | Anlageziel

Der Fonds verfolgt das Ziel, unabhängig von den Entwicklungen an den Kapitalmärkten hohe positive Erträge in Euro zu erwirtschaften. Dabei strebt der offensiv ausgerichtete, weltweit anlegende All-Wetter-Fonds gegenüber Aktien deutlich reduzierte Kursschwankungen an.





ALPHA  
TREND  
FUND

MONATSBERICHT DEZEMBER 2021 | Seite 1

### 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 aktienähnliche Renditen bei gegenüber Aktien deutlich reduzierten 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 (Haltdauer i.d.R. 5-12 Tage) eingegangen werden, verfolgt HEDGE+ eine – ebenfalls kurzfristig orientierte – LONG/SHORT-Systematik bei internationalen Aktien- und Rentenindizes (Haltdauer 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 Portfolios ebenfalls geeignet.

**Fondspreis 116,95 EUR | +1,18%**

**WKN / ISIN**  
A2GDW9 / 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.

**Verwahrestellenvergütung**  
bis zu 0,04% p.a.

**Erfolgshonorar**  
15% des Mehrertrags ggü. Benchmark

**Erstausgabepreis**  
100 EUR am 23.04.2018

**Geschäftsjahr**  
1. Mai bis 30. April

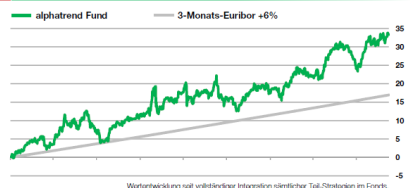
**Gewinnverwendung**  
Ausschüttend

**Mindestanlage / Sparpläne**  
Keine / Der Fonds ist sparplänlich.

**Mindestaktienquote**  
Keine

**Fondsvolumen**  
16,01 Mio. Euro

### Wertentwicklung | Chart




Wertentwicklung seit vollständiger Integration sämtlicher Teil-Strategien im Fonds.

### Portfolioaufteilung

Allokation nach Anlageklassen	Strategie und Methodik	Trendzyklus / Investitionsdauer
US-Einzelaktien 60%	GALAXY BREAKOUT CONTRARIAN SWING	Long / Flat Long / Flat
Aktien-Indizes 25%	HEDGE+ BREAKOUT CONTRARIAN SWING	Long / Short Long / Short Long / Short
Renten-Indizes 25%	HEDGE+ BREAKOUT CONTRARIAN SWING	Long / Short Long / Short Long / Short

\* in % aufgestuft



P.A.M. Prometheus Asset Management GmbH | Elisabeth-Seibert-Str. 19, 40764 Langerfeld | Tel.: 02173 / 39875-0 | info@prometheus.de | www.prometheus.de



# alphatrend Fund | Die Doppelstrategie.

## *Aktuelles Anlageuniversum*

### Hochliquide Einzelaktien

(mit dynamischer Währungsabsicherung in EUR)

AbbVie, Abbott Labs, Accenture, Adobe, Advanced Micro, Alibaba, Alphabet, 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

### Internationale Aktienmärkte

Über Index-Futures:

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

### Internationale Rentenmärkte

Über Index-Futures:

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





# alphatrend Fund | Die Doppelstrategie.

## Wie wird investiert?

Strategie	Investments	Positionierung	Time in Market	Haltedauer
GALAXY 50%	Einzelaktien	LONG / FLAT	40%	Ø 5-12 Tage
	Aktien-Indizes			
HEDGE+ 50%	Aktien-Indizes	LONG / SHORT	100%	Ø 8-16 Tage
	Renten-Indizes			



Bei GALAXY handelt es sich um ein rein regelbasiertes Handelssystem, welches ausschließlich in hochliquide Aktien und Aktien-Indizes investiert. Die Strategie ist kurzfristig opportunistisch ausgerichtet. Einstiegssignale werden dabei von drei voneinander unabhängigen Sub-Systemen generiert: **Breakout** (Trendfolge), **Swing** (Handel von „dips“ im laufenden Trend) und **Contrarian** (Antizyklus). Verkaufssignale erfolgen entweder auf Basis einer *Take Profit*-Systematik (Gewinnrealisierung bei Erreichen des Zielkurses) oder durch Stop-Loss-Limit (Risikobegrenzung). Die Haltedauer der einzelnen Positionen beträgt i.d.R. 5-12 Tage. Die Strategie ist in einer Position entweder investiert (=LONG) oder in Cash (=FLAT). Im Rahmen von GALAXY gibt es keine SHORT-Positionen.



HEDGE+ investiert systematisch und rein regelbasiert in die wichtigsten und liquidesten globalen Aktien- und Renten-Indizes über Futures. Handelssignale basieren ebenfalls auf einer **Breakout**-, **Swing**- oder **Contrarian**-Systematik.

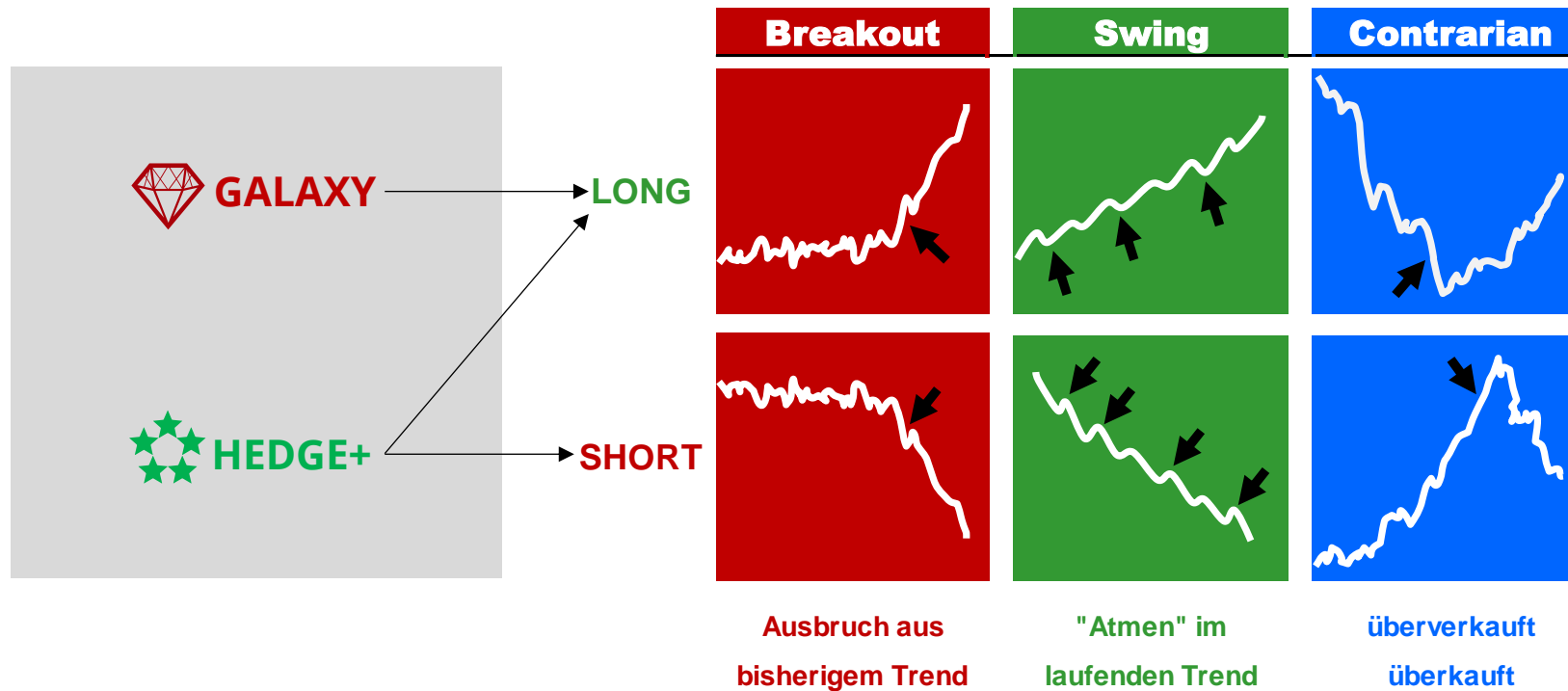
HEDGE+ agiert somit sowohl zyklisch als auch antizyklisch. Die Strategie ist in den einzelnen Indizes entweder LONG (auf steigende Kurse) oder SHORT (auf fallende Kurse) ausgerichtet. Mit einer Haltedauer der Positionen von i.d.R. 8-16 Tagen ist HEDGE+ kurzfristig-opportunistisch ausgerichtet.



# alphatrend Fund | Die Doppelstrategie.

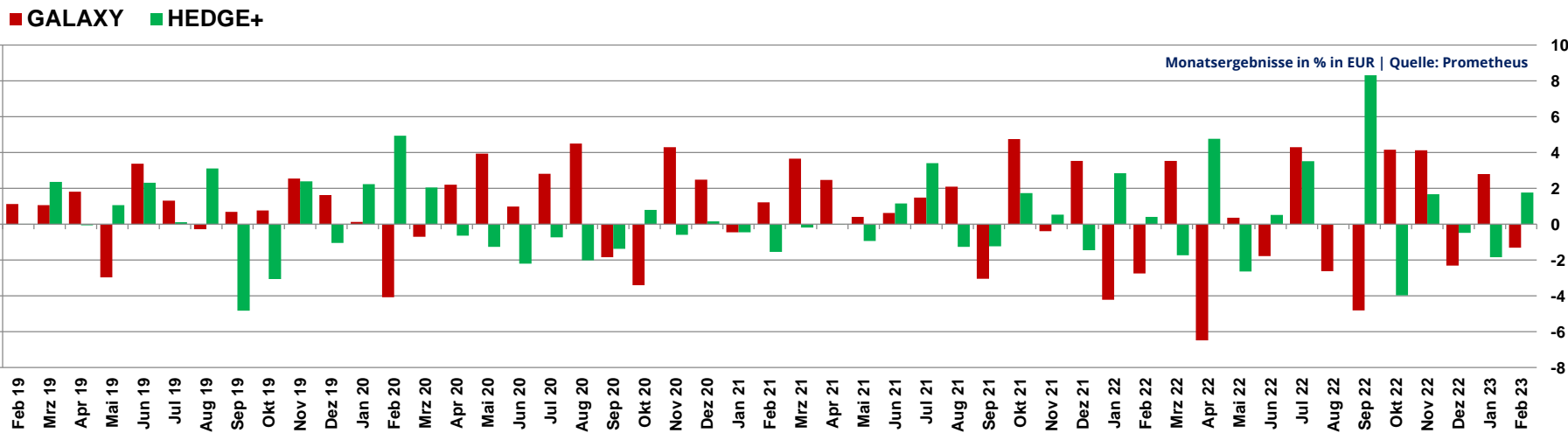
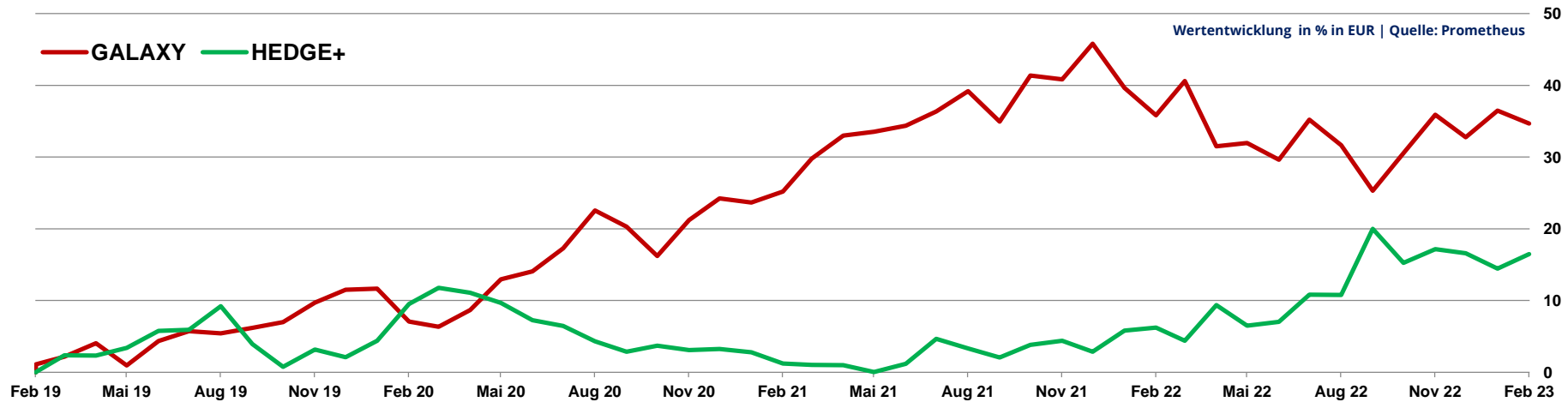
## Wie wird investiert?

Bei **GALAXY** und **HEDGE+** werden für die Signalgebung jeweils 3 Systematiken angewendet – **Breakout**, **Swing** und **Contrarian**. Während bei **HEDGE+** sowohl LONG- als auch SHORT-Signale zum Einsatz kommen, nutzt **GALAXY** nur LONG-Signale.



# alphatrend Fund | Die Doppelstrategie.

## Wie wird investiert?



### GALAXY

LONG / FLAT-Systematik in hochliquiden Internationalen Aktieneinzelwerten

### HEDGE+

LONG- und SHORT-Positionen in Futures Auf Internationale Aktien- und Renten-Indizes

Die nebenstehend dargestellten Ergebnisse von GALAXY und HEDGE+ berücksichtigen sämtliche Transaktionskosten, nicht jedoch die administrativen Fondskosten wie Managementfee, Depotbankgebühr etc.



# alphatrend Fund | Ergebnisse

	JAN	FEB	MRZ	APR	MAI	JUN	JUL	AUG	SEP	OKT	NOV	DEZ	JAHR
2003	-1.62%	3.71%	-1.37%	5.56%	7.01%	0.83%	1.91%	1.19%	2.20%	1.40%	0.23%	2.56%	25.9%
2004	2.17%	2.39%	0.14%	-1.46%	-0.53%	1.67%	1.44%	3.51%	-1.73%	3.43%	0.81%	1.40%	13.9%
2005	0.03%	-0.84%	-0.90%	1.34%	3.61%	0.36%	0.54%	-3.66%	-1.31%	0.04%	1.67%	1.30%	2.0%
2006	2.12%	0.63%	0.75%	2.09%	-0.73%	-0.31%	0.77%	1.57%	2.65%	0.17%	0.36%	-1.11%	9.3%
2007	0.59%	1.11%	0.25%	1.90%	1.55%	-1.87%	2.54%	2.81%	1.18%	1.59%	2.38%	0.24%	15.2%
2008	1.52%	1.03%	-1.06%	2.52%	0.05%	-2.93%	5.00%	1.89%	-2.22%	0.96%	-1.36%	2.98%	8.4%
2009	-3.46%	-2.79%	1.96%	4.10%	0.48%	0.21%	6.00%	0.46%	2.32%	-3.68%	5.27%	-3.66%	6.8%
2010	-0.79%	1.90%	3.67%	2.94%	1.36%	0.20%	3.76%	0.66%	0.87%	2.38%	-0.52%	4.20%	22.5%
2011	1.86%	-1.16%	-1.08%	0.03%	0.23%	-0.64%	0.71%	2.15%	2.79%	3.83%	0.82%	2.17%	12.2%
2012	3.07%	3.41%	-0.12%	-0.21%	-0.01%	1.21%	3.64%	-0.84%	2.23%	0.85%	1.03%	1.42%	16.7%
2013	3.42%	1.38%	2.33%	2.76%	-0.78%	1.22%	0.29%	-0.82%	2.21%	1.79%	-0.40%	1.31%	15.6%
2014	-0.30%	1.43%	0.41%	3.83%	1.58%	0.91%	1.45%	5.00%	-0.50%	-1.25%	3.88%	0.93%	18.6%
2015	1.71%	0.06%	-1.43%	-1.96%	1.11%	0.75%	1.85%	-0.10%	0.78%	3.18%	-1.49%	-1.66%	2.7%
2016	2.23%	-0.08%	2.61%	-0.92%	0.05%	2.78%	1.22%	-0.92%	-0.35%	-0.57%	-1.17%	1.11%	6.0%
2017	0.30%	3.61%	-1.13%	2.04%	0.26%	-2.09%	0.23%	1.06%	-0.36%	2.34%	0.52%	0.43%	7.3%
2018	4.28%	-0.78%	0.71%	-1.46%	2.58%	-0.57%	0.49%	2.47%	-1.31%	-2.34%	0.57%	-0.36%	4.2%
2019	3.56%	1.19%	3.18%	1.27%	-2.11%	4.76%	0.60%	2.91%	-4.24%	-2.84%	4.78%	0.42%	13.8%
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%	8.5%
2021	-1.57%	-0.87%	+3.43%	+2.17%	-0.96%	+1.54%	+4.36%	+0.59%	-4.90%	+6.01%	0.26%	1.18%	11.8%
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%	-2.5%
2023	0.53%	0.38%											0.9%



**Ergebnisse des Backtests**  

**Ergebnisse des Fonds**



## alphatrend Fund | Die Doppelstrategie.

### *Besonderheit: Entwicklung in der Startphase*

Die einzelnen Strategien des **alphatrend 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.

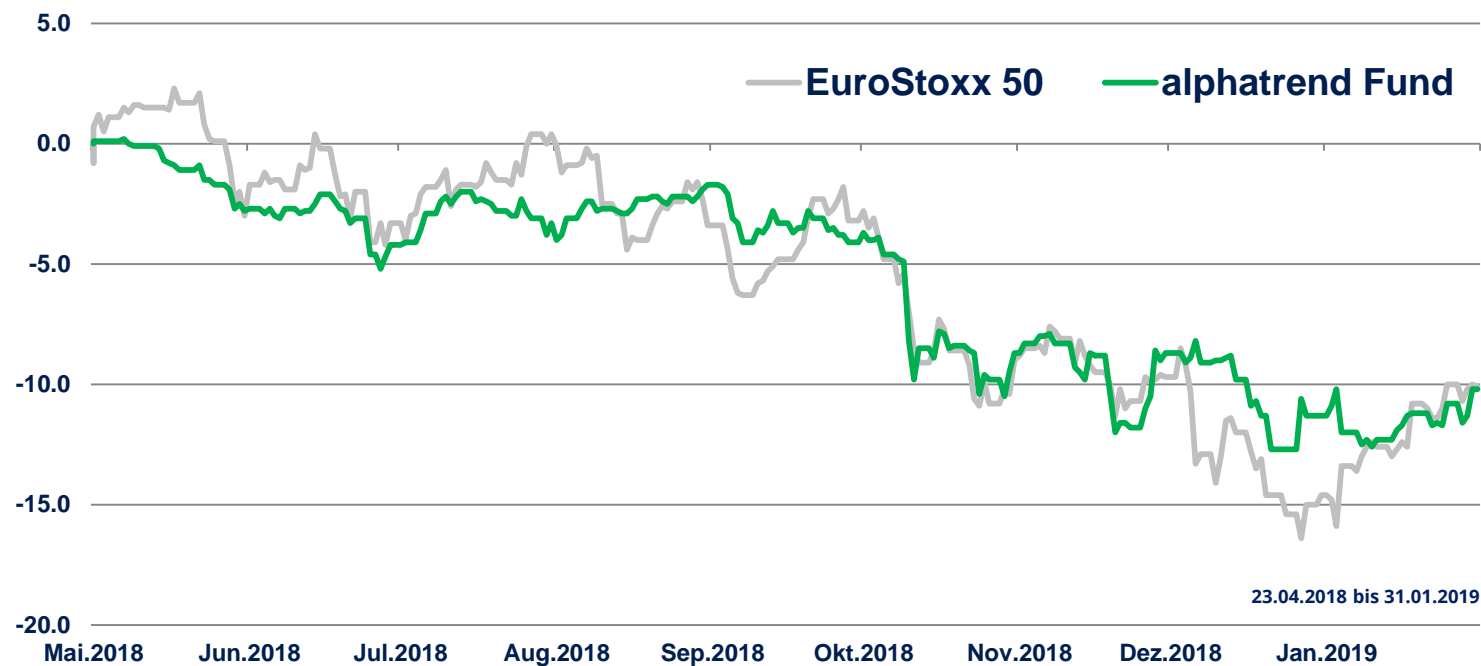
Seit dem 04.02.2019 setzt der Fonds die in dieser Präsentation dargestellten Strategien vollständig um.





## alphatrend Fund | Die Doppelstrategie.

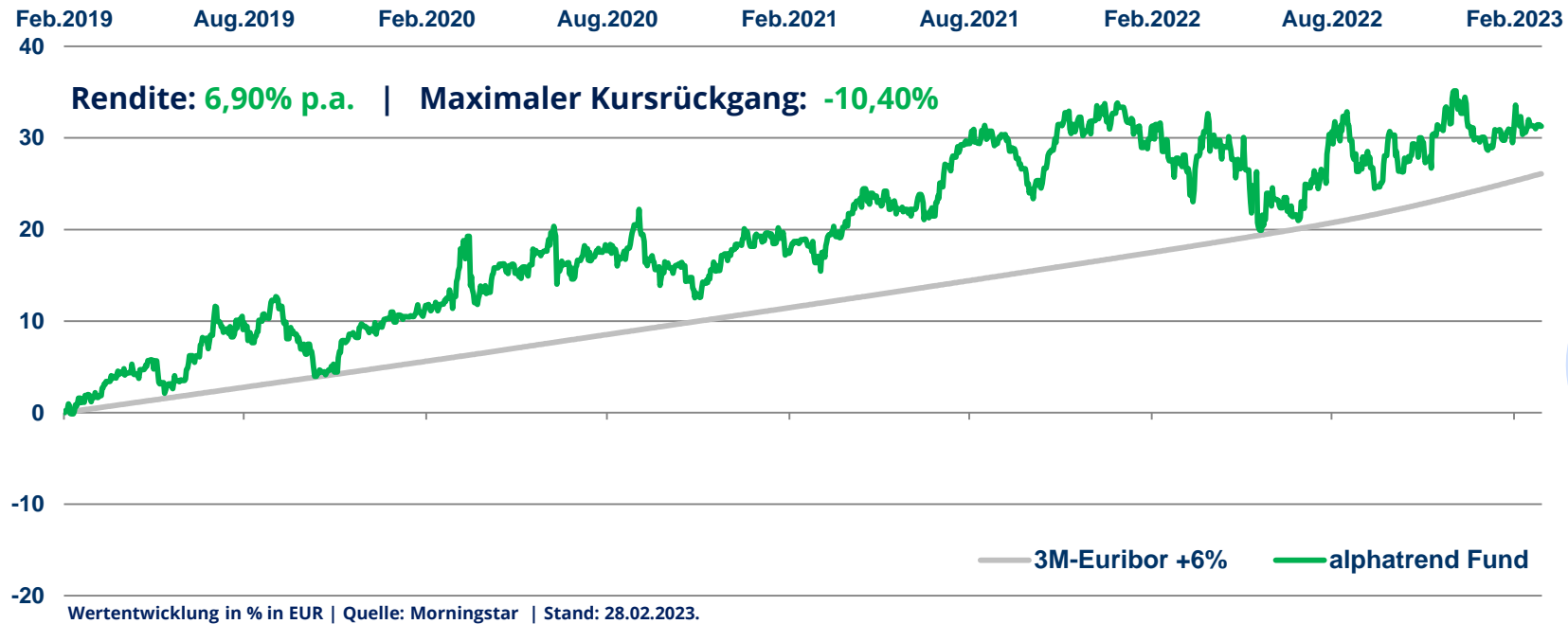
***Besonderheit: Entwicklung in der Startphase***





# alphatrend Fund | Die Doppelstrategie.

*Ergebnisse seit vollständiger Integration der Strategien*



Wertentwicklung des **alphatrend Fund** seit Umsetzung der in dieser Präsentation dargestellten Anlagestrategien.

# Was andere sagen. | €uro fondsxpess

ALTERNATIVE INVESTMENTS

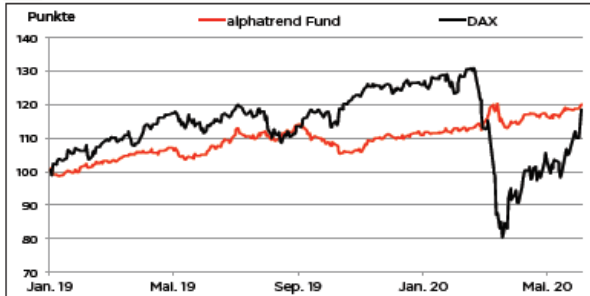
**€uro** fondsxpess  
Ausgabe 23/2020

## Erfolgreich den Trends auf der Spur

**Alphatrend Fund** Der von der Langenfelder Fondsboutique Prometheus verwaltete Fonds hat sich auch während der Corona-Krise blendend geschlagen

Die auf regelbasierte und trendfolgende Fonds spezialisierte Fondsboutique Prometheus hat mit dem alphatrend Fund einen der in jüngster Zeit am besten performenden alternativen Fonds im Programm. Konzipiert ist er als All-Wetter-Fonds und soll aktienähnliche Renditen bei deutlich reduzierten Kursschwankungen bieten. „Ziel ist es, dass sich der Fonds weitestgehend unbeeinflusst von der Marktentwicklung verhält und zwischenzeitliche Kursverluste die 15-Prozent-Marke nicht überschreiten“, sagt André Kunze, Geschäftsführer bei Prometheus. Durch die Flexibilität des Fonds profitierte er sogar von der Krise. „Der Schlüssel hierzu liegt in der Flexibilität und der Diversität der dem Fonds zugrunde liegenden fünf regelbasierten Handelssysteme“, sagt Kunze. Laut dem Experten kommen bei dem Fonds sowohl zyklische beziehungsweise trendfolgende als auch antizyklische Investmentansätze zum Einsatz. Dabei nutzen die fünf unterschiedlichen Handelssysteme neben den 60 liquidesten US-Einzelaktien auch sieben internationale Aktien- und acht Rentenindizes. Zudem werden Trends in drei unterschiedlichen Zeitfenstern beobachtet und gehandelt (intraday, mehrere Tage, Wochen bis Monate). Shortpositionen werden jedoch je nach Marktlage nur bei den Aktien- und Rentenindizes eingegangen. Bei Einzelwerten ist Kunze entweder long oder gar nicht investiert. *Im Vergleich zu anderen systematischen und trendfolgenden Fonds hat der alphatrend Fund auch den Wechsel vom Bären- zum Bullenmarkt in diesem Frühjahr sehr gut hinbekommen. Ein vielversprechendes Produkt.*

**ALPHATREND FUND**



Der Aufwärtstrend des alphatrend Fonds ist intakt. Bislang kann die Entwicklung überzeugen. Den Fonds sollte man auf alle Fälle auf der Watchlist haben.

**DATEN ALPHATREND FUND**

ISIN (thesaurierend)	LU1687250271
Auflagedatum	9. April 2018
Volumen	10,9 Mio. Euro
Laufende Kosten p. a.	2,76 %
Erfolgsgebühr	15% > 50% MSCI World und 50 % Citi WGBI EUR Hdg.





# 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 | 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 gegenüber 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	



***Für weitergehende Fragen stehen wir Ihnen jederzeit gerne zur Verfügung.***

***Auf den Austausch mit Ihnen freuen wir uns!***

**Ihr Ansprechpartner:**

**André Kunze**

Geschäftsführender Gesellschafter



**André Kunze**



andre.kunze@prometheus.de



+49 2173 398 75-11





## 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.