



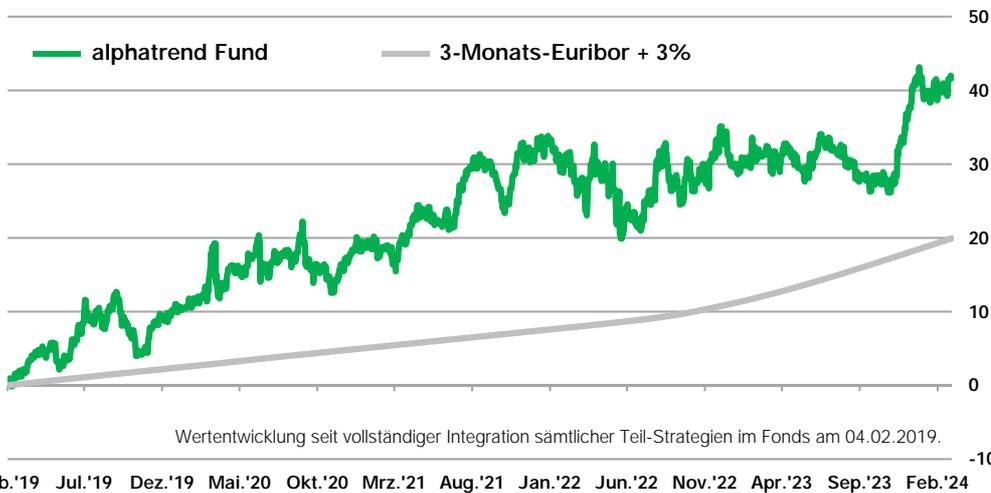
Fondsstrategie

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

25,12 Mio. Euro

Portfolioaufteilung

Allokation nach Anlageklassen

US-Einzelaktien 50%

Aktien-Indizes 25%*

Renten-Indizes 25%*

* risikoadjustiert

Strategie und Methodik

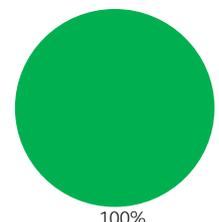
GALAXY
BREAKOUT Long / Flat
CONTRARIAN Long / Flat
SWING Long / Flat

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





MONATSBERICHT FEBRUAR 2024

www.alphatrend-fund.de

Bericht des Anlageberaters | Februar

Auch im Februar entwickelten sich die Aktienmärkte vordergründig positiv. So konnten die großen Indizes zumeist recht deutlich zulegen. Der europäische **EuroStoxx 50** und der US-Aktienindex **S&P500** legten auf Monatssicht um rund 5% zu. Wie bereits in den vorangegangenen Monaten fehlte den Märkten allerdings die Breite, denn die Indizes wurden erneut nur von wenigen großen Titeln beflügelt. Die deutschen Nebenwerte-Indizes **SDAX** und **MDAX** beendeten den Februar beispielsweise mit leicht negativen Vorzeichen. Auch hieran wird deutlich, dass die Rallye an den Aktienmärkten sehr selektiv verläuft.

Wie bereits im Januar schwächelten die Rentenmärkte auch im Februar. Der deutsche Rentenindex **REXP TR** gab um 1,2% nach, der globale Staatsanleihen-Index **FTSE WGBI TR** verlor auf Euro-Basis 0,93%. Letzterer profitierte allerdings von seinem hohen US-Gewicht und der leichten Aufwertung des US-Dollar um rund 0,4% gegenüber dem Euro.

Für den **alphatrend Fund** verlief der Februar insgesamt erfreulich. Ausschlaggebend hierfür war der positive Monatsverlauf des aktienorientierten Handelssystems **GALAXY**, welches mit seiner **LONG/FLAT**-Strategie in den wichtigsten internationalen Einzelaktien einen Ergebnisbeitrag von +2,88% erzielen konnte.

Das zweite im Fonds zum Einsatz kommende Handelssystem **HEDGE+** tat sich mit seiner **LONG/SHORT**-Systematik in den wichtigsten internationalen Aktien- und Rentenindizes hingegen etwas schwer und verlor auf Monatssicht 0,70%. Insbesondere zu Monatsbeginn hatte **HEDGE+** mit der Richtungssuche der Märkte seine Probleme.

Insgesamt konnte der **alphatrend Fund** den Februar mit einem Plus von 2,18% beenden.

Die Märkte im Februar

AKTIEN:

Euro Stoxx 50	+4,93% in EUR
S&P 500	+5,17% in USD

RENTEN:

REXP TR	-1,19% in EUR
FTSE WGBI TR	-0,93% in EUR

WÄHRUNGEN:

USD	+0,38% in EUR
YEN	-1,96% in EUR

ROHSTOFFE:

Öl (Brent)	+2,34% in USD
Gold	-0,61% in USD

VOLATILITÄT:

VIX (CBOE)	-6,62% in USD
------------	---------------

Wertentwicklung | Monats- und Jahresergebnisse

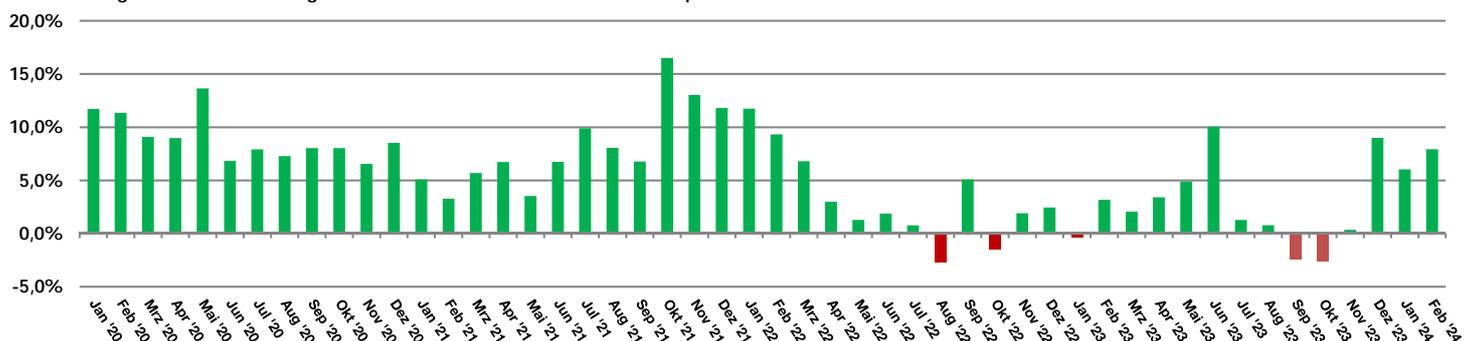
	Jan	Feb	Mrz	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	Gesamt
2024	-2,19%	+2,18%											-0,06%
2023	+0,53%	+0,38%	-0,04%	-0,18%	-1,21%	+3,19%	-1,08%	-3,38%	-0,32%	-0,81%	+6,82%	+5,17%	+8,99%
2022	-1,62%	-3,02%	+1,05%	-1,49%	-2,59%	-1,84%	+7,46%	-2,89%	+2,93%	-0,61%	+3,71%	-3,17%	-2,46%
2021	-1,57%	-0,87%	+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.: +7,10% | 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

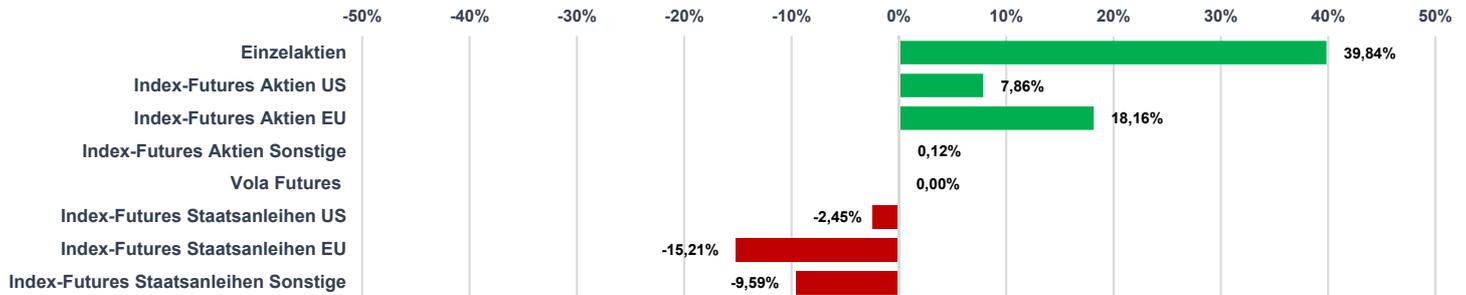
Dargestellt werden die Ergebnisse sämtlicher rollierender 12-Monatsperioden.



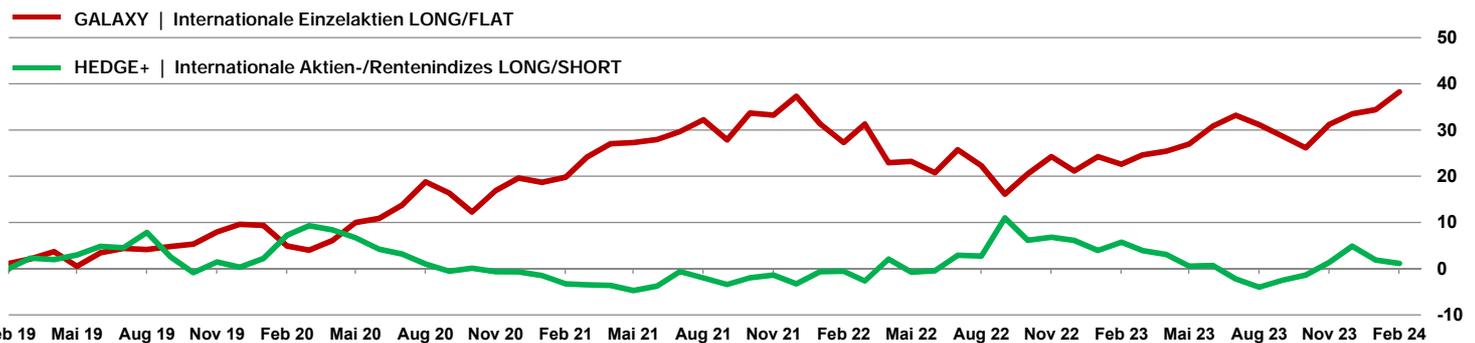
Quelle: Morningstar, Prometheus. Sämtliche Ergebnisse und Kennzahlen verstehen sich seit vollständiger Integration sämtlicher Teil-Strategien im Fonds am 04.02.2019 | Stand: 29. Februar 2024.



Portfolio Breakdown per 29.02.2024 | 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 29. Februar 2024.