



Lupus alpha Sustainable Return

Nachhaltig: Aktien ohne Stress? Mit 90% Wertsicherung

Nachhaltige Aktienrendite und Wertsicherung: Mit Erfahrung seit 2007.

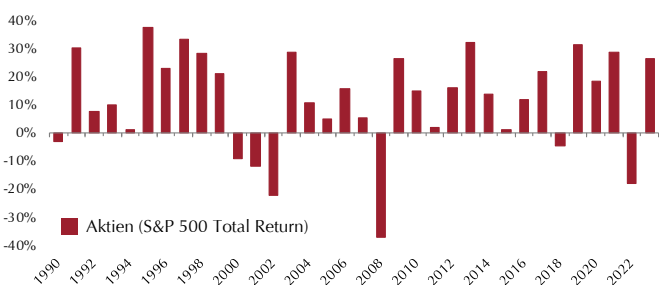
Aktienmärkte halten Anleger in Atem. Und doch sind sie für viele unverzichtbar. Der Lupus alpha Sustainable Return setzt nachhaltige Aktien flexibel als Renditequelle ein. Zusätzlich bietet er eine Wertsicherung. Die Lupus alpha Return Strategie, die die Grundlage für den Fonds bildet, hat seit ihrer Auflegung im Jahr 2007 die Grenze von maximal 10% Verlust pro Kalenderjahr immer gehalten.¹

Klares Konzept mit zwei Zielen: Teilhabe an Aktienrenditen und Wertsicherung¹

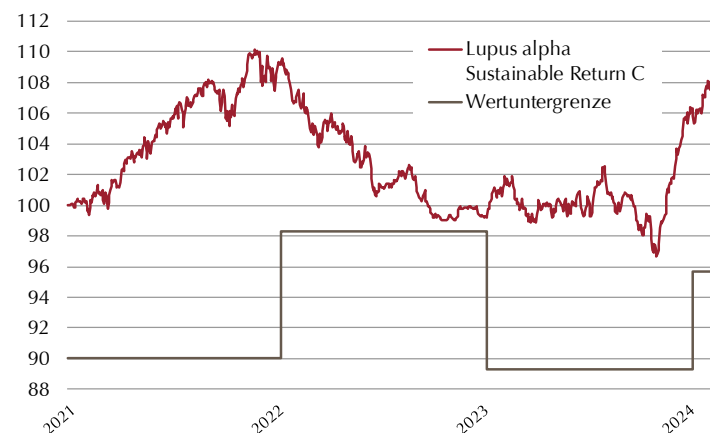
Anleger sollen an den Ertragschancen der globalen Aktienmärkte teilhaben können, aber mit der zusätzlichen Absicherung eines Wertsicherungsansatzes. Dessen Wertuntergrenze passt sich dynamisch an. Wächst das Kapital, wird die Wertsicherung im Folgejahr auf einem höheren Niveau angesetzt.¹

1 Teilhabe an den Renditechancen der globalen Aktienmärkte

Erträge im Kalenderjahr (Beispiel US-Markt)



Quellen: Bloomberg, Lupus alpha; Betrachtungszeitraum: 01.01.1990 – 29.12.2023. Indexperformance dient nur zu Illustration. Vergangene Performance ist keine Garantie für künftige Wertentwicklung. Diese kann sowohl höher als auch geringer ausfallen.



Quellen: Bloomberg, Lupus alpha; Betrachtungszeitraum: 18.12.2020 (Auflegung) bis 31.01.2024. Vergangene Performance ist keine Garantie für künftige Wertentwicklung. Diese kann sowohl höher als auch geringer ausfallen.

¹ Wertuntergrenze von 90% per Kalenderjahresende. Verlustvermeidung, Kapitalerhalt oder die Einhaltung der Wertuntergrenze können zu keiner Zeit garantiert oder gewährleistet werden. Beim Kauf innerhalb eines Jahres kann ein erhöhtes Risiko bestehen. Die Wertuntergrenze wird jedes Kalenderjahr entsprechend dem erzielten Wert des Vorjahres neu festgelegt. Vereinzelt können Derivate auch zur Nutzung der weltweiten Volatilitätsmärkte eingesetzt werden.



Alexander Raviol, Partner, CIO Alternative Solutions

„Wertsicherungsstrategien lassen alle, die Kapital anlegen, auch bei heftigeren Korrekturen ruhiger schlafen.“

So funktioniert die erfolgreiche Wertsicherung seit 2007

Mithilfe von physischen Aktien und reguliert börsengehandelten Optionen kann der Fonds das Renditepotential nachhaltiger globaler Aktien erschließen. Die nachhaltige Strategie setzt Derivate ausschließlich zu Absicherungszwecken ein. Die Optionsstruktur wird aktiv und flexibel gemanagt mit dem Ziel, in unterschiedlichen Marktumfeldern ein sogenanntes asymmetrisches Risikoprofil zu erhalten - also stärker an positiver als an negativer Marktentwicklung teilzuhaben. Die Wertuntergrenze soll dabei in allen vom erfahrenen Portfolio-Management-Team simulierten Extremszenarien nicht unterschritten werden. Seit mehr als 15 Jahren ist das zuverlässig gelungen¹, ohne sich jemals komplett aus dem Markt zurückziehen zu müssen. Der sogenannte Cashlock, bei dem eine Teilhabe an positiven Marktentwicklungen nach einer Krise ausgeschlossen wäre, wurde also immer vermieden.

Lupus alpha Sustainable Return C		
	Ertrag	Volatilität (p. a.)
1 Jahr	6,31%	5,57%
3 Jahre	8,17%	5,47%
5 Jahre	n.a.	n.a.
10 Jahre	n.a.	n.a.
seit Auflage	7,50%	5,41%
s. Auflage (p.a.)	2,35%	-
Sharpe Ratio	0,26	
Max. Drawdown	-12,26%	

Quellen: Bloomberg, Lupus alpha; Stand: 31.01.2024. Vergangene Performance ist keine Garantie für künftige Wertentwicklung. Diese kann sowohl höher als auch geringer ausfallen.

Fondsdetails

Anteilklasse	C	R
ISIN	DE000A2DTNX3	DE000A2QNXM0
Fondswährung	EUR	EUR
Auflegungsdatum	18.12.2020	15.11.2021
Ertragsverwendung	ausschüttend	ausschüttend
Mindestanlagesumme	500.000 EUR	keine
Management-Fee ¹	0,60%	1,00%
Performance-Fee ²	20,0%	20,0%
Ausgabeaufschlag ³	bis zu 5%	
Klassifikation gem. SFDR ⁴	Art. 8	Art. 8
KVG	Lupus alpha Investment GmbH	
Preisveröffentlichung	www.fundinfo.com www.lupusalpha.de	

MSCI

ESG RATINGS⁵



CCC	B	BB	BBB	A	AA	AAA
-----	---	----	-----	---	----	-----

¹ Die Management-Fee ist die Verwaltungsvergütung, die dem Fondsvermögen entnommen und Lupus alpha für Management und Verwaltung gezahlt wird.

² Die Performance-Fee ist eine erfolgsabhängige Vergütung, welche abhängig von der Wertentwicklung oder bei Erreichen bestimmter Ziele erhoben wird, wie zum Beispiel das bessere Abschneiden im Vergleich zu einer Benchmark. Die Kosten können auch erhoben werden, wenn eine im Vorfeld festgelegte Mindest-Performance erzielt worden ist.

³ Der Ausgabeaufschlag ist die Differenz zwischen dem Ausgabepreis und dem Anteilwert. Der Ausgabeaufschlag variiert je nach Fondsart und Vertriebsweg und deckt üblicherweise die Beratungs- und Vertriebskosten ab. Die Vereinnahmung des Ausgabeaufschlags steht im Ermessen der Vertriebsstelle.

⁴ Der Fonds bewirbt ökologische und/oder soziale Merkmale, strebt aber keine nachhaltigen Investitionen als Ziel an. Er ist als Produkt gemäß Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („SFDR“) einzustufen.

⁵ Bei der Betrachtung des ESG Scores wenden wir die Methodologie von MSCI ESG an (MSCI ESG Ratings: <https://www.msci.com/esg-ratings>). Die genannten KPIs werden als portfoliogewichteter Durchschnitt berechnet. Die Angaben beziehen sich auf den Teil des Fonds, für die die entsprechenden Angaben vorliegen.

Disclaimer:

Es handelt sich hierbei um eine Werbemitteilung und nicht um ein investmentrechtliches Pflichtdokument. Die in diesem Factsheet angegebenen Fondsinformationen sind zu allgemeinen Informationszwecken des Anlegers erstellt worden. Sie ersetzen weder eigene Marktrecherchen noch sonstige rechtliche, steuerliche oder finanzielle Information oder Beratung. Das Factsheet stellt keine Kauf- oder Verkaufsaufforderung oder Anlageberatung dar. Es enthält nicht alle für wirtschaftlich bedeutende Entscheidungen wesentlichen Angaben und kann von Informationen und Einschätzungen anderer Quellen/Marktteilnehmer abweichen. Für die Richtigkeit, Vollständigkeit oder Aktualität dieser Unterlage wird keine Gewähr übernommen. Sämtliche Ausführungen gehen von unserer Beurteilung der gegenwärtigen Rechts- und Steuerlage aus. Alle Meinungsäußerungen geben die aktuelle Einschätzung des Portfolio Managers wieder, und können ohne vorherige Ankündigung geändert werden.

Die vollständigen Angaben zu dem Fonds sind dem jeweils aktuellen Verkaufsprospekt sowie ggf. dem Basisinformationsblatt, ergänzt durch den letzten geprüften Jahresbericht bzw. den letzten Halbjahresbericht, zu entnehmen. Ausschließlich rechtsverbindliche Grundlage für den Erwerb von Anteilen an den von der Lupus alpha Investment GmbH verwalteten Fonds, sind der jeweils gültige Verkaufsprospekt und das Basisinformationsblatt, die in deutscher Sprache verfasst sind. Diese erhalten Sie kostenlos bei der Lupus alpha Investment GmbH, Postfach 11 12 62, 60047 Frankfurt am Main, auf Anfrage telefonisch unter +49 69 365058-7000, per Email info@lupusalpha.de, über unsere Homepage www.lupusalpha.de, oder bei der österreichischen Zahl- und Informationsstelle, der Credit Bank Austria AG mit Sitz in A-1010 Wien, Schottengasse 6-8. Anteile der Fonds erhalten Sie bei Banken, Sparkassen und unabhängigen Finanzberatern..

Sofern nicht anders angegeben entsprechen alle dargestellten Wertentwicklungen der Bruttowertentwicklung (BVI-Methode): Die Bruttowertentwicklung berücksichtigt bereits alle auf Fondsebene anfallenden Kosten (z.B. Verwaltungsvergütung) und geht von einer Wiederanlage eventueller Ausschüttungen aus. Die auf Kundenebene anfallenden Kosten wie Ausgabeaufschlag und Depotkosten sind nicht berücksichtigt.

Bitte beachten Sie: Wertentwicklungen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.

Lupus alpha Asset Management AG
Speicherstraße 49-51
D-60327 Frankfurt am Main

Chancen

- Risikoreduzierte Partizipation an den globalen Aktienmärkten ohne Kompromisse beim Thema Nachhaltigkeit einzugehen.
- Im Vergleich zu Aktien meist geringere Verluste.
- Auch bei seitwärts verlaufenden Aktienmärkten attraktive Rendite.

Risiken

- **Adressausfallrisiken:** Wenn Kontrahenten vertraglichen Zahlungsverpflichtungen nicht oder nur teilweise nachkommen, können Verluste durch Vermögensverfall von Ausstellern eintreten.
- **Konzentrationsrisiken:** Durch die Konzentration des Anlagevermögens auf wenige Märkte oder Vermögensgegenstände ist der Fonds von diesen wenigen Märkten/Vermögensgegenständen besonders abhängig.
- **Risiken im Zusammenhang mit Derivategeschäften:** Derivategeschäfte zu Absicherungszwecken verringern das Gesamtrisiko des Fonds, können jedoch die Renditechancen schmälern.
- **Operationale Risiken:** Der Fonds kann Opfer von Betrug, kriminellen Handlungen oder Fehlern von Mitarbeitern der Gesellschaft oder externer Dritter werden. Schließlich kann seine Verwaltung durch äußere Ereignisse wie Brände, Naturkatastrophen u. Ä. negativ beeinflusst werden.
- **Liquiditätsrisiken:** In bestimmten Phasen, wie z. B. in Zeiten größerer Marktturbulenzen, kann es Schwierigkeiten geben, Vermögenspositionen zum gewünschten Zeitpunkt bzw. zum gewünschten Preis aufzulösen.
- **Marktrisiko:** Die Wertentwicklung von Finanzprodukten hängt von der Entwicklung der Kapitalmärkte ab.

Ausführliche Hinweise zu Chancen und Risiken entnehmen Sie bitte dem aktuellen Verkaufsprospekt.

THE ALPHA WAY TO INVEST

