Lupus alpha Return (R)

(Stand: 30.04.2025) 1

Bei diesem Factsheet handelt es sich um Werbematerial und nicht um ein investmentrechtliches Pflichtdokument.

Portfoliomanagement

Marvin Labod

Alexander Raviol

Mark Ritter

Stephan Steiger

Die Teammitglieder verfügen über durchschnittlich 21 Jahre Investmenterfahrung.

Anlagestrategie

Der Lupus alpha Return ermöglicht Investoren ein risikokontrolliertes Investment, um an den Ertragschancen der globalen Aktienmärkte zu partizipieren. Durch aktive Steuerung des Risikos soll der maximale kalenderjährliche Verlust bei negativer Marktentwicklung auf -10% begrenzt werden [A]. Die Umsetzung erfolgt über börsengehandelte Derivate (Futures, Optionen). Als Basisportfolio dient ein liquides Rentenportfolio mit hoher Bonität.

Kategorie / Style

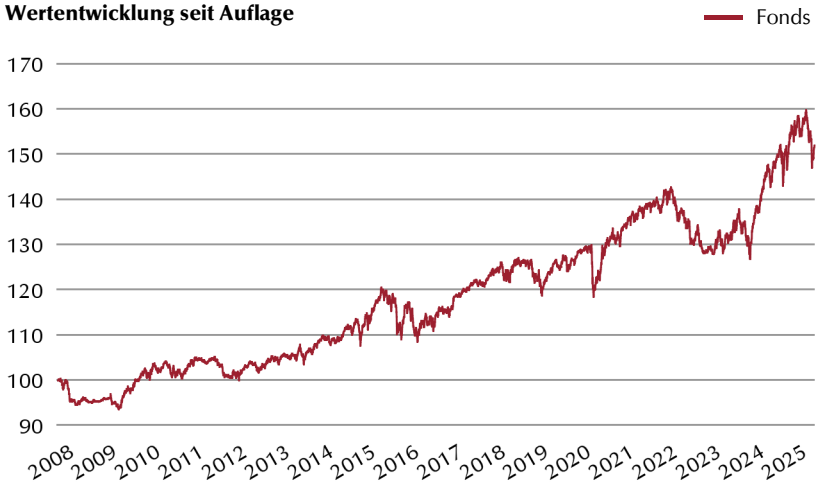
Globale Aktien / Wertsicherung 90% [A]

Key Facts

Shareklasse	ISIN / WKN	Fondsvolumen	Management-Fee [5]	Performance-Fee [6]	SFDR [S]	Auflagedatum	Benchmark
R	DE000A0MS734 A0MS73	121,89 Mio EUR	zurzeit 1,04%	keine	8	10.10.2007	keine

Performance & Risiko

Wertentwicklung seit Auflage



Wertentwicklung (brutto) [1]

	Fonds
Kalenderjahr	-1,82%
1 Jahr	5,60%
3 Jahre	12,46%
5 Jahre	23,03%
Seit Auflage p.a.	2,41%

Risikokennzahlen seit Auflage [3]

Volatilität	5,29%
Sharpe Ratio	0,33
Max. Drawdown	-11,16%

Highlights

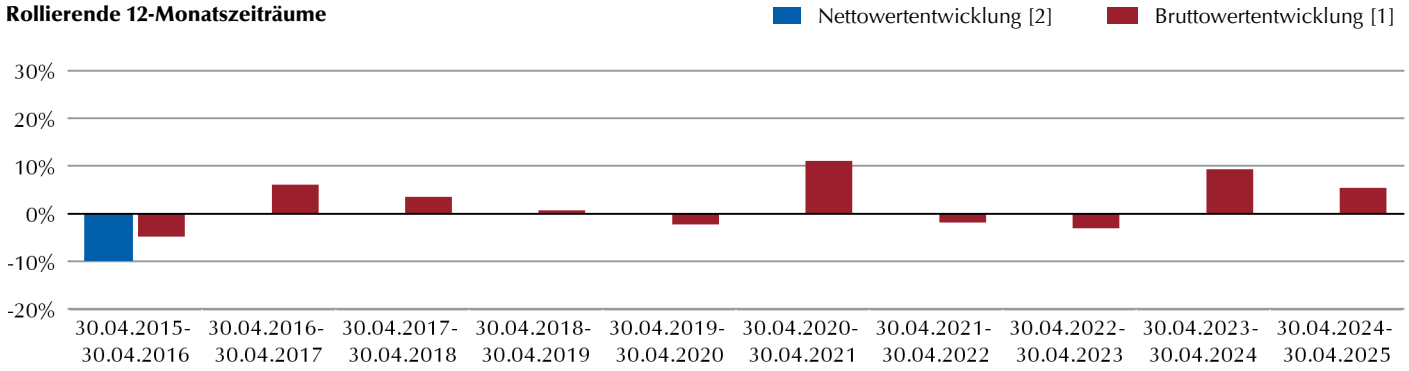
- Partizipation an Aktien mit Begrenzung der Drawdowns
- Wertsicherung [A] je Kalenderjahr ohne Cash Lock
- Umsetzung über liquide und börsennotierte Instrumente
- Hohe Expertise des Teams aus 10+ Spezialisten mit langjähriger Erfahrung und Track-Record seit 2007
- Asymmetrisches Risiko-Rendite-Profil; Berücksichtigung von ESG Kriterien

Performance & Risiko im Detail

Fondskennzahlen [3]

Volatilität p.a.	Max. Verlust 90 Tage	VaR 95 -10	VaR 99 - 10	Sharpe Ratio
5,29%	-8,03%	-2,39%	-3,39%	0,33

Rollierende 12-Monatszeiträume

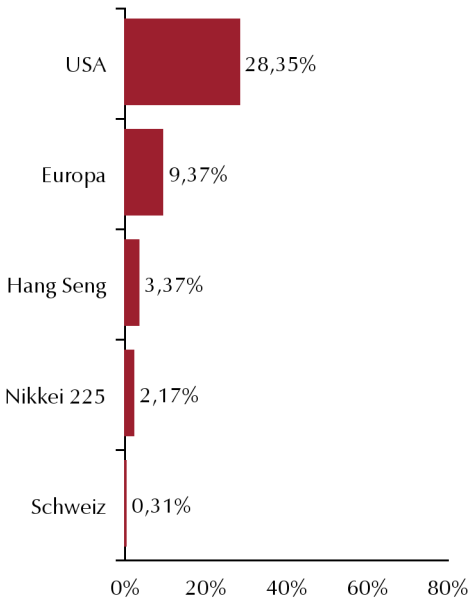


Monatliche Wertentwicklung in % (brutto)

	Jan.	Feb.	Mrz.	Apr.	Mai	Jun.	Jul.	Aug.	Sep.	Okt.	Nov.	Dez.	Jahr
2021	-0,19	0,48	1,12	0,71	0,40	0,52	-0,23	0,66	-1,30	1,39	-0,36	2,23	**5,51**
2022	-1,62	-2,18	0,40	-1,54	-0,02	-3,53	1,69	-1,78	-1,55	0,41	0,75	-1,33	**-9,94**
2023	2,44	-0,75	1,57	-0,47	-0,17	2,87	2,18	-2,31	-2,61	-3,04	6,41	2,21	**8,19**
2024	1,01	3,26	2,31	-2,56	2,11	1,65	0,59	0,99	1,54	-0,8	2,55	-1,25	**11,84**
2025	1,65	0,09	-2,90	-0,62									

Portfolio Allokation/ Zusammensetzung

Aktien Exposure



Gesamt Aktien Exposure: 43,57%

Top 10 Holdings

Emittent	Rating [8]	Kupon	Fälligkeit	% Fonds
Berlin Hyp AG 22/25	AAA	1,25%	25.08.2025	2,90%
DZ HYP AG	AAA	0,50%	13.11.2025	2,85%
UniCredit Bank Austria AG	AAA	0,63%	16.01.2026	2,68%
Achmea Bank NV	AAA	0,01%	16.06.2025	2,54%
Caisse Francaise de Financement Local	AAA	0,50%	19.01.2026	2,51%
BNZ International Funding Ltd/London	AAA	0,63%	03.07.2025	2,50%
Muenchener Hypothekenbank eG	AAA	2,75%	24.09.2025	2,47%
Danske Mortgage Bank PLC	AAA	2,13%	16.09.2025	2,46%
Toronto-Dominion Bank/The	AAA	1,71%	28.07.2025	2,46%
Toronto-Dominion Bank/The	AAA	0,63%	06.06.2025	2,46%

Nachhaltigkeit im Detail

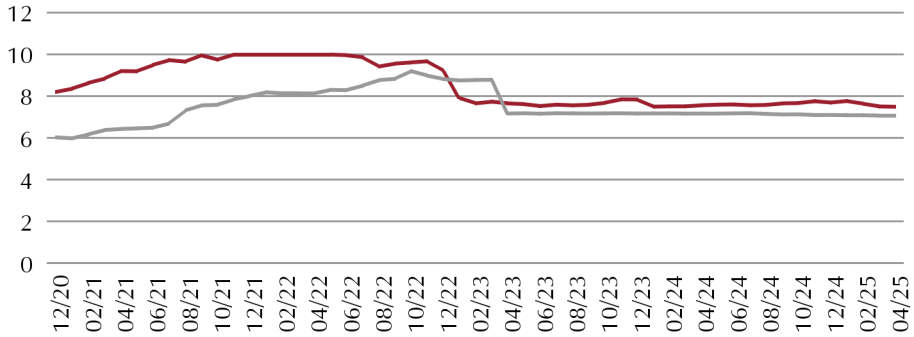
MSCI-Rating [S2]

AA

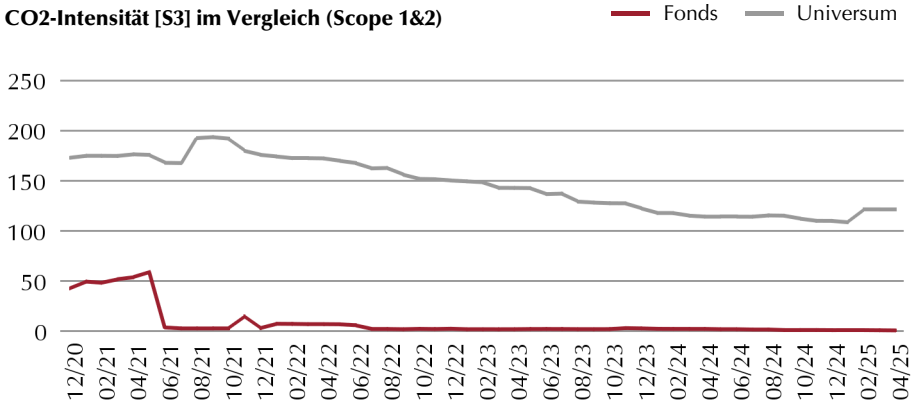
CCC	B	BB	BBB	A	AA	AAA

Weitere Informationen zum Thema Nachhaltigkeit bei Lupus alpha finden Sie mit nebenstehendem QR-Code.

Durchschnittlicher ESG Score [S2]



CO2-Intensität [S3] im Vergleich (Scope 1&2)



ESG-Evaluation

Gravierende Kontroversen [S4]	Verstöße gegen UN Global Compact [S5]
Der Fonds ist in 0 Unternehmen investiert, die in sehr schwere Kontroversen verwickelt sind	Der Fonds ist in 0 Unternehmen investiert, die gegen UN Global Compact Prinzipien verstoßen.
Keine	**Keine**

Mindestausschlüsse (Auswahl) [S1]

Der Fonds ist nicht in Unternehmen investiert, die folgende Umsatzgrenzen überschreiten

Produktion und Vertrieb von Streumunition, Anti-Personen-Minen und kontroversen Waffen	✓ 0%	Energieerzeugung aus Kraftwerkskohle	✓ 10%
Produktion und Vertrieb von Militärgütern	✓ 5%	Abbau von Kraftwerkskohle	✓ 5%
Produktion und Vertrieb von Atomstrom	✓ 10%	Abbau und Exploration für Ölsand und Ölschiefer	✓ 0%
Produkte und Dienstleistungen für die Atomindustrie	✓ 10%	Produktion von Tabak	✓ 5%

Eckdaten / Stammdaten

Shareklasse	R
ISIN	DE000A0MS734
WKN	A0MS73
Bloomberg, Reuters RIC	LUPARTR GR / A0MS73X.DX
Auflagedatum Fonds	10.10.2007
Anteilswert (in EUR)	64,14
Auflagedatum Shareklasse	10.10.2007
Fondsvolumen	121,89 Mio. €
Volumen Shareklasse	16,12 Mio. €
Ertragsverwendung [7]	ausschüttend
Letzte Ausschüttung	22.11.2024: 0,95 EUR pro Anteil
KVG	MONEGA Kapitalanlagegesellschaft mbH
Verwahrstelle	Kreissparkasse Köln
Rechtsform	OGAW
Domizil	Deutschland
Geschäftsjahresende	31.08.
Preisveröffentlichung:	www.fundinfo.com

Handelsinformationen

Mindestanlage	keine
Cut-Off	10:30 Uhr
NAV Berechnung	täglich
Forward Pricing	nein
Valuta	-
Bruchstückfähigkeit	nein
Ausgabeaufschlag [4]	bis zu 5%
Vertriebszulassung	Deutschland, Frankreich

Gebühren

Gesamtkostenquote (TER)	1,16% p.a. Stand: 31.08.2024
Management-Fee [5]	zurzeit 1,04%
Performance-Fee [6]	keine

Chancen

- Der Fonds profitiert von der positiven Wertentwicklung der allokierten Aktienmärkte. Anstiege dieser Aktienmärkte eröffnet die Chance auf eine stetig steigende Jahresperformance bei begrenztem Risiko.
- Die Ausrichtung des Fonds ermöglicht es, Abschwünge zu bremsen und das Verlustpotential einzuschränken. Die auf Jahresbasis kalkulierten Maximalverluste liegen bei 10% gegenüber dem Vorjahresschlusskurs.

Risikoindikator [9]

‹ Typischerweise geringere Rendite — Typischerweise höhere Rendite ›

1	2	**3**	4	5	6	7

‹ Geringeres Risiko — Höheres Risiko ›

Zusätzlich zu den allgemein beschriebenen Risiken im Verkaufsprospekt ist das Risiko von Wertschwankungen auf den internationalen Märkten in Optionen und Futures auf Aktienindizes von besonderer Bedeutung.

Der Lupus alpha Return Retail Kunden ist in Kategorie 3 eingestuft, weil sein Anteilpreis typischerweise eher gering schwankte und deshalb sowohl Verlustrisiken als auch Gewinnchancen entsprechend eher niedrig sein können.

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

Risiken

- **Aktienrisiko:**
  Aktien unterliegen erfahrungsgemäß starken Kursschwankungen und somit auch dem Risiko von Kursrückgängen.
- **Zinsänderungsrisiko:**
  Mit der Investition in festverzinslichte Wertpapiere ist das Risiko verbunden, dass sich das Marktzinsniveau während der Haltezeit der Papiere verändert.
- **Kapitalmarktrisiko:**
  Die Kurs- oder Marktentwicklungen von Finanzprodukten hängt insbesondere von der Entwicklung der Kapitalmärkte ab, die von der allgemeinen Lage der Weltwirtschaft sowie wirtschaftlichen und politischen Rahmenbedingungen in den jeweiligen Ländern beeinflusst wird.
- **Währungsrisiko:**
  Vermögenswerte des Fonds können in einer anderen Währung als der Fondswährung angelegt sein. Fällt der Wert dieser Währung gegenüber der Fondswährung, so reduziert sich der Wert des Fondsvermögens.
- **Adressenausfallrisiko:**
  Durch den Ausfall eines Ausstellers oder eines Vertragspartners, gegen den der Fonds Ansprüche hat, können für den Fonds Verlust entstehen.
- **Liquiditätsrisiko:**
  Der Fonds kann einen Teil seines Vermögens in Papieren anlegen, die nicht an einer Börse oder einem ähnlichen Markt gehandelt werden.
- **Derivaterisiko:**
  Der Fonds setzt Derivate sowohl zu Investitions- als auch zu Absicherungszwecken ein. Die erhöhten Chancen gehen mit erhöhten Verlustrisiken einher.
- **Zielfondsrisiko:**
  Der Fonds legt in Zielfonds an, um bestimmte Märkte, Regionen oder Themen abzubilden. Die Wertentwicklung einzelner Zielfonds kann hinter der Entwicklung des jeweiligen Marktes zurückbleiben.

Rechtliche Hinweise

[1] Quelle: Lupus alpha; 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. Sofern nicht anders angegeben entsprechen alle dargestellten Wertentwicklungen der Bruttowertentwicklung.
Bitte beachten Sie: Wertentwicklungen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.

[2] Quelle: Lupus alpha; Die Nettowertentwicklung geht von einer Modellrechnung mit einem investierten Betrag von EUR 1.000,--, dem maximalen Ausgabeaufschlag sowie einem Rücknahmeabschlag (siehe Stammdaten) aus. Sie berücksichtigt keine individuellen Kosten des Anlegers, wie bspw. eine Depotführungsgebühr. (Bitte vergleichen Sie hierzu das Preisverzeichnis Ihrer depotführenden Stelle.)
Bitte beachten Sie: Wertentwicklungen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.

[3] Volatilität: Die Volatilität ist die Schwankungsbreite eines Wertpapierkurses oder Index um seinen Mittelwert in einem festen Zeitraum. Ein Wertpapier wird als volatil bezeichnet, wenn sein Kurs stark schwankt.
Maximaler Verlust 90 Tage: Gibt den maximalen Verlust an, den ein Investor innerhalb eines 90 Tages Zeitraumes erlitten hätte.
VaR 95 – 10: Der Value at Risk definiert die Verlusthöhe, die mit einer Wahrscheinlichkeit von 95% innerhalb von 10 Tagen nicht überschritten wird.
VaR 99 – 10: Der Value at Risk definiert die Verlusthöhe, die mit einer Wahrscheinlichkeit von 99% innerhalb von 10 Tagen nicht überschritten wird.
Sharpe Ratio: Die Sharpe Ratio setzt die Überschussrendite (Fondsperformance abzüglich Geldmarktzins) zur Schwankungsbreite (Volatilität) ins Verhältnis und gibt die Rendite des Fonds pro Risikoeinheit an. Je höher die Sharpe Ratio, desto mehr Rendite wurde bezogen auf das eingegangene Risiko erwirtschaftet.
Der Maximum Drawdown bezeichnet den höchsten jemals aufgetretenen kumulierten Verlust einer Anlage innerhalb des betrachteten Zeitraums.

[4] 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.

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

[6] 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.

[7] Ausschüttende Fonds legen die erwirtschafteten Erträge nicht wieder an, sondern zahlen sie an die Anleger aus.

[8] Interne Ratings.

[9] Die Darstellung bildet den Gesamtrisikoindikator (SRI) des Basisinformationsblattes des Fonds ab und beinhaltet nicht alle möglichen Risiken. Fonds unterliegen marktbedingten Kursschwankungen, die zu Verlusten, bis hin zum Totalverlust des eingesetzten Kapitals, führen können. Ergänzende Risiken und detaillierte Informationen zu dem Gesamtrisikoindikator entnehmen Sie bitte dem aktuellen Basisinformationsblatt. Das Basisinformationsblatt und den aktuellen Verkaufsprospekt können Sie auf www.lupusalpha.de abrufen.

[S] 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.

[A] Verlustvermeidung, Kapitalerhalt oder die Einhaltung der Wertuntergrenze kann zu keiner Zeit garantiert oder gewährleistet werden. Beim Kauf innerhalb eines Jahres kann ein erhöhtes Risiko bestehen.

[S1] Weitere Informationen zu der angewendeten ESG-Systematik des Fonds entnehmen Sie bitte dem aktuellen Verkaufsprospekt, ergänzt um die ESG-spezifische Methodik des Fonds auf der Homepage der Gesellschaft: www.lupusalpha.de

[S2] 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 Universums bzw. Fonds, für die die entsprechenden Angaben vorliegen. Das Universum beinhaltet die Mitglieder des Euro Stoxx Large sowie des S&P 100 Indexes.

[S3] Für die CO2-Intensität werden die CO2-Emissionen jedes Unternehmens (in t) im Portfolio zu den Umsätzen des Unternehmens (in Mio. USD) ins Verhältnis gesetzt. Anschließend wird der portfoliogewichtete Durchschnitt dieser Kennzahl berechnet. Die Angaben beziehen sich auf den Teil des Universums bzw. Fonds, für die die entsprechenden Angaben vorliegen. Das Universum beinhaltet die Mitglieder des Euro Stoxx Large sowie des S&P 100 Indexes. Grundlage bilden die MSCI ESG Climate Change Metrics: https://www.msci.com/our-solutions/esg-investing/ climate-solutions/climate-data-metrics.

[S4] Die Kategorisierung einer Kontroverse als „sehr schwer“ erfolgt nach der Definition von MSCI ESG Research. Unternehmen mit sehr schweren, aber bereits abgeschlossenen Kontroversen, sind nicht grundsätzlich ausgeschlossen.

[S5] Der UN Global Compact ist eine Initiative der Vereinten Nationen für verantwortungsvolle Unternehmensführung. Weitere Informationen finden Sie unter https://www.globalcompact.de/.

Die Informationsanbieter Lupus alpha, MSCI ESG Research LLC und ihre verbundenen Unternehmen (die "ESG-Parteien"), beziehen ihre Informationen aus Quellen, welche sie für zuverlässig halten. Jedoch übernimmt keine der ESG-Parteien eine Garantie für die Echtheit, Richtigkeit und/oder Vollständigkeit der hierin enthaltenen Daten. Keine der ESG-Parteien übernimmt ausdrückliche oder implizite Garantien jeglicher Art, und die ESG-Parteien lehnen hiermit ausdrücklich alle Zusicherungen der Verwendbarkeit und Eignung für einen bestimmten Zweck in Bezug auf die hierin enthaltenen Daten ab. Keine der ESG-Parteien haftet für etwaige Fehler oder Aussagen im Zusammenhang mit den hierin enthaltenen Daten. Ohne das Vorstehende einzuschränken, haftet keine der ESG-Parteien für direkte, indirekte, fahrlässige, grob fahrlässige oder andere Schäden (einschließlich entgangener Gewinne), selbst wenn sie über die Möglichkeit solcher Schäden informiert wurden.

Die Kapitalverwaltungsgesellschaft darf in Wertpapiere und Geldmarktinstrumente öffentlicher Emittenten im Sinne des § 206 Absatz 2 KAGB jeweils mehr als 35 Prozent des Wertes des OGAW-Sondervermögens anlegen, wenn diese von einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder seinen Gebietskörperschaften, einem anderen Mitgliedsstaat der Vereinten Nationen oder den Europäischen Gemeinschaften ausgegeben oder garantiert worden sind.

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 Meinungsaussagen 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 Monega Kapitalanlagegesellschaft mbH, Stolkgasse 25-45, 50667 Köln, Telefon (02 21) 390 95-0, Telefax (02 21) 390 95-400, E-Mail: info@monega.de, Webseite: www.monega.de.

Lupus alpha Investment GmbH

Speicherstraße 49–51
D-60327 Frankfurt am Main

THE ALPHA WAY TO INVEST