

Lupus alpha Commodity Invest

Stand: 29.02.2016

Portfoliomanagement



Gerd Henning Beck

- s. 2006 Lupus alpha Asset Management AG
- s. 2005 Beck-Tradingproject, Director

Daniel Bathe

- s. 2007 Lupus alpha Asset Management AG

Matthias Kuzinski

- s. 2012 Lupus alpha Asset Management AG
- 2005 - 2012 BHF Bank

ISIN-Nummer:

DE000A1C6G76

Auflegungsdatum:

31.01.2011

Management-Fee:

1,5%

Ausgabeaufschlag:

bis zu 5%

Performance-Fee:

20%

Hurdle Rate:

EONIA + 3% p.a.

High-Watermark:

ja

Fondsvolumen:

0,03 Mio EUR

Rücknahmepreis:

92,22 EUR

Ertragsverwendung:

ausschüttend

Preisveröffentlichung:

www.fundinfo.com

Reuters:

A1C6G7X.DX

Bloomberg:

LUPALCI GR

Letzte Ausschüttung:

0,26 EUR / Anteil / 05.03.2013

Anlagestrategie:

Der Lupus alpha Commodity Invest verfolgt die Grundidee, in allen Marktphasen eine stetige und absolut positive Rendite innerhalb verschiedenster Rohstoffmärkte zu erzielen, unabhängig davon, ob Märkte steigen oder fallen.

Hierzu werden direktionale (marktgerichtete) Long- und Short-Strategien und non-direktionale (marktneutrale) Handelsstrategien miteinander kombiniert. Als Basis der Investmententscheidungen dient ein eigens entwickeltes Faktorenmodell, das fundamentale und technische Methoden miteinander verbindet.

Ziel des Lupus alpha Commodity Invest ist es, diese beiden Methoden in einem Modell zu vereinen, um so die Stärken der jeweiligen Ansätze zu nutzen und die Schwächen zu kompensieren.

Wertentwicklung und Risikokennzahlen:

	Jan.	Feb.	Mrz.	Apr.	Mai	Jun.	Jul.	Aug.	Sep.	Okt.	Nov.	Dez.	Jahr
2014	-0,25%	1,08%	-1,63%	-0,03%	0,20%	0,93%	-0,43%	0,14%	0,04%	-0,80%	0,11%	-0,58%	-1,24%
2015	1,52%	-0,93%	-1,07%	-0,41%	0,48%	-1,51%	-1,39%	-0,73%	-0,73%	-0,86%	-0,74%	0,27%	-5,97%
2016	-1,00%	0,15%											-0,85%

aktueller Monat:	0,15%	Volatilität p.a.	3,39%
3 Monate	-0,73%	Maximum Draw Down	-11,43%
1 Jahr	-7,30%	VaR 95 - 10	0,00%
Kalenderjahr	-0,85%	VaR 99 - 10	0,00%
seit Auflegung	-6,73%	Sharpe Ratio	n.a.
seit Auflegung p.a.	-1,36%		

Wertentwicklung seit Auflage
(in Fondswährung = Euro, auf 100 indexiert)



Korrelationen:

Renten global (JPM Global Gov. Bonds)	Aktien global (MSCI World Equity)	Commodities global (DJ-UBS Comdty TR)
0,01	-0,02	0,07

Lupus alpha Commodity Invest

Stand: 29.02.2016

Performance-Fee:

Bis zu 20% des Betrages, um den die Anteilwertentwicklung am Ende einer Abrechnungsperiode den Ertrag aus einer als Vergleichsmaßstab herangezogenen Geldmarktanlage in der Abrechnungsperiode übersteigt, jedoch insgesamt höchstens bis zu 2,5% des Durchschnittswerts des Sondervermögens in der Abrechnungsperiode. Als Vergleichsmaßstab wird EONIA zzgl. 3,00% p.a. festgelegt. Näheres regelt der Abschnitt 14. des Verkaufsprospektes.

Chancen:

- Sie können von vielfältigen Chancen im Rohstoffbereich profitieren.
- Sie können dabei von einer flexiblen Investmentstrategie profitieren: Unterschiedliche Marktzyklen verschiedener Rohstoffe werden zielgerichtet ausgenutzt.
- Das breitgefächerte Rohstoffuniversum ermöglicht eine breite Streuung.

Risiken:

- Adressenausfallrisiken:
Wenn Kontrahenten vertraglichen Zahlungsverpflichtungen nicht oder nur teilweise nachkommen, können Verluste für den Fonds entstehen. Auch bei sorgfältiger Auswahl der Wertpapiere kann nicht ausgeschlossen werden, dass 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 Derivatgeschäften:
Derivatgeschäfte zu Absicherungszwecken verringern das Gesamtrisiko des Fonds, können jedoch die Renditechancen schmälern. Werden Geschäfte als Teil der Anlagestrategie mit Derivaten getätigt, kann sich das Verlustrisiko des Fonds zumindest zeitweise erhöhen.
- Länder- oder Transferrisiken:
Wenn ein ausländischer Schuldner trotz Zahlungsfähigkeit aufgrund fehlender Transferfähigkeit oder -bereitschaft seines Sitzlandes Leistungen nicht erbringen kann, so können Zahlungen an das Sondervermögen ausbleiben. Oder die Zahlungen erfolgen in einer Währung, die aufgrund von Devisenbeschränkungen nicht mehr konvertierbar ist.
- 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.

Disclaimer:

Bei diesem Dokument handelt es sich um eine Werbung gemäß §302 KAGB, welche mit größter Sorgfalt erstellt wurde. Eine Garantie für die Richtigkeit aller Angaben kann nicht übernommen werden. Die Lupus alpha Investment GmbH veröffentlicht ausschließlich produktbezogene Informationen und erteilt keine Anlageempfehlungen. Der Wert der Anteile kann schwanken und wird nicht garantiert. Wertentwicklungen in der Vergangenheit sind keine Garantie für die zukünftige Wertentwicklung. Ausschließlich rechtsbindende Grundlage für den Erwerb von Anteilen an den von der Lupus alpha Investment GmbH verwalteten Publikumsfonds, sind der jeweils gültige Verkaufsprospekt und die wesentlichen Anlegerinformationen, die in deutscher Sprache verfasst sind. Diese erhalten Sie bei der Lupus alpha Investment GmbH, Postfach 11 12 62, 60047 Frankfurt am Main, auf Anfrage telefonisch unter +49 69 365058-7000, per Email service@lupusalpha.de oder über unsere Homepage www.lupusalpha.de. Anteile der Fonds erhalten Sie bei Banken, Sparkassen und unabhängigen Finanzberatern. Alle angegebenen Daten sind vorbehaltlich der Prüfung durch die Wirtschaftsprüfer zu den jeweiligen Berichtsterminen. Die Ausführungen gehen von unserer Beurteilung der gegenwärtigen Rechts- und Steuerlage aus. Für die Richtigkeit der hier angegebenen Informationen übernimmt Lupus alpha keine Gewähr. Änderungen vorbehalten.