

PRESSEINFORMATION

alpha beta asset management und Monega legen Aktienfonds „alpha beta Aktien Global Plus“ auf

- **Globales, breit diversifiziertes Aktienportfolio auf ETF-Basis mit zweidimensionalem Risiko-Overlay**
- **Absolute-Return-Strategie mit dem Ziel aktienähnlicher Erträge bei deutlicher Reduzierung von Volatilität und Drawdown gegenüber einer reinen Aktienanlage**
- **Langjährige Asset Allokation- und Risikomanagement-Expertise von alpha beta asset management kombiniert mit fundiertem, wissenschaftlich-quantitativen Know-how von Quasol**

Frankfurt am Main, 21. September 2017 – Die alpha beta asset management gmbh hat gemeinsam mit der Monega Kapitalanlagegesellschaft (KAG) mbH den Aktienfonds „alpha beta Aktien Global Plus“ (DE000A141WRO I-Tranche) aufgelegt. Die Anlagestrategie ist das Ergebnis der zu Jahresbeginn gestarteten Kooperation von alpha beta asset management mit der Quasol GmbH, einem auf finanzmathematische Fragestellungen spezialisierten Unternehmen.

„Die Aktienmärkte erscheinen risikobehafteter denn je – gleichfalls sind aus unserer Sicht Aktien zur Erzielung attraktiver Erträge zwar nicht alternativlos, aber ein wichtiges, hochliquides Instrument“, erläutert Markus van de Weyer, Gründer und Geschäftsführer von alpha beta asset management. „Das Besondere am alpha beta Aktien Global Plus ist unser zweidimensionales Risikomanagement. Es basiert einerseits auf unserem Sharpe-Ratio-Indikatoren-Ansatz, der sich bereits seit mehr als vier Jahren u.a. in unserem Fonds „Multi-Asset Global 5“ erfolgreich bewährt hat. Zusätzlich werden Strukturbrüche in den Volatilitäten einzelner Assetklassen als Risikomanagementsignale identifiziert. Diese Methode wurde von Prof. Dr. Daniel Ziggel, Geschäftsführer der Quasol GmbH und wissenschaftlicher Beirat unserer Gesellschaft, entwickelt und mit unserem bestehenden Risikomanagement kombiniert.“

Der alpha beta Aktien Global Plus soll vorrangig mittels kostengünstiger Exchange Traded Funds (ETF) und börsennotierter Futures in ein globales, breit diversifiziertes Aktienuniversum investieren. Die Basis bildet ein proprietärer Aktienindex, der nicht wie im Regelfall marktkapitalisierungsgewichtet ist, sondern kleineren Unternehmen sowie sich entwickelnden Ländern und Regionen ein tendenziell höheres Gewicht zuordnet. Zudem sollen bevorzugt solche Länder allokiert werden, die Nachhaltigkeitskriterien erfüllen. Ein zweidimensionales Risikomanagement in Kombination mit aktivem Management steuert die effektive Aktienquote zwischen 0 und 100% und senkt den Investitionsgrad in Marktschwächephase. Der Fonds wird mit Blick auf das neue Investmentsteuergesetz ab 1. Januar 2018 als Aktienfonds (Mindestquote 51% Aktien) verwaltet. Ziel der Strategie ist ein mittlerer bis hoher einstelliger Ertrag p.a. über einen Investmentzyklus, allerdings mit deutlich vermindertem Risiko gegenüber einer reinen Aktienanlage. Die durchschnittliche Volatilitätserwartung pro Jahr liegt bei ca. 8-10% p.a.

„Wir fördern innovative Investmentstrategien, die sich der jeweiligen Marktphase anpassen“, erläutert Christian Finke, Geschäftsführer der Monega KAG, den Investmentansatz des alpha beta Aktien Global Plus. „Der Fonds eignet sich insbesondere für risikoorientierte Anleger, die von den Chancen des Aktienmarktes profitieren wollen, gleichzeitig jedoch den Fokus auf geringere Volatilität legen.“

„Wir freuen uns, zusammen mit der Monega KAG unsere neue Aktienstrategie als Publikumsfonds für private und institutionelle Investoren anbieten zu können“, ergänzt Markus van de Weyer.

Der Fonds alpha beta Aktien Global Plus wurde als Publikumsfonds nach deutschem Recht aufgelegt, wobei die Monega KAG als Kapitalverwaltungsgesellschaft fungiert. Verantwortliche Portfolio Manager sind die beiden Geschäftsführer Markus van de Weyer und Carsten Vennemann von alpha beta asset management.

KURZPORTRAIT: ALPHA BETA AKTIEN GLOBAL PLUS	
ISIN:	DE000A141WR0 (I-Tranche) / DE000A2DL379 (R-Tranche)
WKN:	A141WR (I-Tranche) / A2DL37 (R-Tranche)
Bloomberg-Ticker:	ABAKGPI (I-Tranche) / ABAKGPR (R-Tranche)
Fondskategorie:	Globale Aktien
Fondstyp:	OGAW-Sondervermögen (UCITS)
Fondsdomizil:	Deutschland
Portfolio Management:	alpha beta asset management GmbH, Frankfurt a.M.
Mindesteranlage:	100.000 EUR (nur bei I-Tranche)
Erstausgabepreis:	100,00 EUR (I-Tranche), 50,75 EUR (R-Tranche)
Verwaltungsgebühr:	0,75% (I-Tranche), 0,95% (R-Tranche)
Ausgabeaufschlag:	z.Zt. 0% (I-Tranche), 1,5% (R-Tranche)
Frequenz der Preisberechnung:	Börsentäglich
Geschäftsjahresende:	31.08.
Fondswährung:	EUR
Ertragsverwendung:	Ausschüttung
Auflage:	15.09.2017
Verwahrstelle:	Kreissparkasse Köln
Kapitalverwaltungsgesellschaft:	Monega Kapitalanlagegesellschaft mbH, Köln
Vertriebszulassung:	Deutschland
Erwerbbarkeit:	u.a. Hausbanken, Fondsplattformen und -banken

Über alpha beta asset management gmbh:

Die alpha beta asset management gmbh ist ein unabhängiger und spezialisierter Asset Manager mit Fokus auf aktive Asset Allokation und Risikomanagement. Das Unternehmen wurde 2012 gegründet mit Sitz im Operturm in Frankfurt am Main. Die Geschäftsführer Markus van de Weyer und Carsten Vennemann verfügen über ca. 20 Jahre nationale und internationale Erfahrung im Portfolio Management. Vor Unternehmensgründung haben sie rund EUR 10 Mrd. Anlegergeld in mehr als 200 Fonds bei einer deutschen Kapitalverwaltungsgesellschaft verantwortet. Die Fonds- und Vermögensverwaltungskonzepte folgen konsequent einem Absolute-Return-Ansatz und richten sich sowohl an institutionelle als auch private Anleger. Der systematische, regelbasierte Investmentprozess basiert auf zahlreichen quantitativen Indikatoren und unterliegt einem strikten Risikomanagement. alpha beta asset management verwaltet Publikumsfonds sowie individuelle (Spezialfonds-)Mandate für institutionelle Investoren.

Weitere Informationen unter www.abam-gmbh.com.

Über Monega Kapitalanlagegesellschaft mbH:

Die Monega Kapitalanlagegesellschaft mbH mit Sitz in Köln wurde 1999 als ein Unternehmen der DEVK Versicherungen, der Sparda-Banken und des Bankhauses Sal. Oppenheim jr. & Cie KGaA gegründet. Ihre bundesweiten Vertriebspartner sind die DEVK Versicherungen sowie die Berater in den Geschäftsstellen der Sparda-Banken. Monega verwaltet aktuell ein Fondsvermögen von 5,4 Milliarden Euro in Publikums- und Spezialfonds. Das Spektrum der angebotenen Fondsstrategien umfasst alle Anlagemöglichkeiten von Aktien-, Renten oder Geldmarktnahen Fonds bis hin zu Wertsicherungs- und Best-of-Two-Strategien. Darüber hinaus verwaltet Monega maßgeschneiderte Publikumsfonds, so genannte Partnerfonds, die sie für institutionelle Anleger und deren Kunden auflegt.

Weitere Informationen unter www.monega.de.

Über Quasol GmbH:

Die Quasol GmbH ist ein auf quantitative-finanzmathematische Fragestellungen spezialisiertes Unternehmen. Es bietet maßgeschneiderte Lösungen im Bereich Risikomanagement, Asset Allokation und Portfoliooptimierung. Das Geschäftsmodell basiert auf einem stark wissenschaftlichen Ansatz. Durch enge Zusammenarbeit mit Universitäten wird ein fortlaufender Theorie-Praxis-Transfer gewährleistet. Kunden sind nationale sowie internationale Finanzunternehmen und Softwarehäuser. Rechenkernelösungen von Quasol sind aktuell in sechs europäischen Ländern im Einsatz. Die geschäftsführenden Gesellschafter Vanessa Peters und Prof. Dr. Daniel Ziggel haben das Unternehmen in 2010 gegründet. Herr Dr. Ziggel ist Professor für Allgemeine Betriebswirtschaftslehre, insbesondere Wirtschaftsmathematik und Statistik, an der FOM Hochschule für Oekonomie & Management.

Weitere Informationen unter www.quasol.de.

Kontakt:

Sandra Kirstein

T+49 69 767 578 14

sandra.kirstein@abam.email

alpha beta asset management gmbh

Operturm, Bockenheimer Landstraße 2-4

60306 Frankfurt am Main

Rechtliche Informationen:

Investmentfonds unterliegen dem Risiko sinkender Anteilspreise, da sich Kursrückgänge bei den im Fonds enthaltenen Wertpapieren bzw. der zugrundeliegenden Währung im Anteilspreis widerspiegeln. Erträge bzw. Ergebnisse aus der Vergangenheit sind keine Garantie für zukünftige Erfolge. Ausführliche produktspezifische Informationen und Hinweise zu Chancen und Risiken des Fonds sind den aktuellen Verkaufsprospekten, den Vertragsbedingungen sowie den Jahres- und Halbjahresberichten zu entnehmen, die kostenlos in deutscher Sprache über die Monega KAG (www.monega.de) und alpha beta asset management gmbh (www.abam-gmbh.com) bezogen werden können. Die Inhalte dieser Presseinformation stellen keine Handlungsempfehlung dar, sie ersetzen weder die individuelle Anlageberatung durch eine Bank noch die Beurteilung der individuellen Verhältnisse durch einen Steuerberater. Der Kauf oder Verkauf von Fondsanteilen erfolgt ausschließlich auf der Grundlage des genehmigten Verkaufsprospektes. Trotz größtmöglicher Sorgfalt kann die alpha beta asset management gmbh weder ausdrücklich noch stillschweigend Gewähr oder Haftung für die Richtigkeit, Glaubwürdigkeit oder Vollständigkeit jeglicher Informationen übernehmen.