

## ■ Pressemitteilung

Köln, 28. April 2020

### **Monega: Greiff Systematic Allocation Fund trotz der Krise**

#### **Aktienorientierter Fonds erwirtschaftet mit regelbasierter Strategie in der Spitze fast 12 Prozent\* und besteht Feuertaufe im Corona-Crash**

Der von der Greiff capital management AG und der Monega Kapitalanlagegesellschaft (KAG) mbH aufgelegte Greiff Systematic Allocation R/I (DE000A2JN5C2/DE000A2JN5B4) hat sich wiederholt erfolgreich bewährt. Der in den US- und Euroland-Aktien anlegende Fonds, der auf einer automatisierten, täglichen Analyse von Einzelaktien anhand charttechnischer Formationen basiert, konnte seit seiner Auflage im November 2018 bereits zweimal seine Stärke in Bezug auf die Begrenzung von Aktienverlusten beweisen. Ziel der Strategie ist es, durch die tägliche Anpassung der Aktienquote, die in Hausse-Phasen hoch und in Baisse-Phasen niedrig ist, stille Reserven im Aktienbereich bei deutlich reduzierten Schwankungen aufzubauen. Gemanagt wird der Fonds von Marc Schnieder, Experte für quantitative, regelbasierte Anlagestrategien bei der Greiff capital management AG in Freiburg.

„Wir fördern innovative Investmentstrategien, die sich der jeweiligen Marktphase anpassen“, kommentiert **Christian Finke, Geschäftsführer der Monega KAG**, den besonderen Investmentansatz des Greiff Systematic Allocation. „Der Fonds richtet sich vor allem an Anleger, die von den Chancen an den internationalen Aktienmärkten profitieren wollen, gleichzeitig jedoch Wert auf eine geringere Volatilität und die Begrenzung von Verlusten legen.“

So konnte der Greiff Systematic Allocation Fund im aktuellen **Corona-Crash**, in dem der Maximum Drawdown 38 Prozent betrug, den Verlust mit 17 Prozent deutlich reduzieren. Die Netto-Aktienquote des Fonds liegt derzeit bei 5 Prozent, wodurch das weitere Verlustpotenzial sehr stark begrenzt ist. „Schlagen sich die Auswirkungen des Corona Virus noch stärker auf die Aktienmärkte nieder, sollten unsere Anleger kaum davon betroffen sein. Und wendet sich das Blatt ins Positive, profitiert der Fonds durch die konsequente Anpassung der Aktienquote nach oben“, resümiert **Fondsmanager Marc Schnieder** die Vorzüge seiner erprobten Allokationsstrategie.

**Ziel des Greiff Systematic Allocation** ist es, langfristig aktienmarktähnliche Renditen mit deutlich reduzierten Drawdowns im Vergleich zum Aktienmarkt zu erzielen. Hierfür werden über einen softwaregestützten, automatisierten, täglichen Prozess rund 700 Aktien aus den USA (S&P 500 und S&P 400) sowie aus dem Euroland (EURO STOXX) analysiert. Positive charttechnische Analysen führen zu einzelnen Aktienkäufen, negative Analysen zu Aktienverkäufen. Leerverkäufe finden dabei nicht statt. Jede Aktie im Fonds hat ein sehr kleines, vorgegebenes Gewicht beim Kauf. Dadurch ergibt sich eine hohe Diversifikation und nur kleine Änderungen der Aktienquote bei einzelnen Käufen und Verkäufen. „Werden von unserer Software nach und nach vermehrt Kaufkandidaten gefunden, steigt die Aktienquote im Fonds, während die Aktienquote sinkt, wenn überwiegend Verkaufskandidaten ermittelt werden“, erläutert **Schnieder**, „Die Aktienquote ist somit ein Resultat aus der Analyse einzelner Aktien,“ so der Portfoliomanager. Nicht in Aktien investiertes Fondsvermögen wird als Kasse sowie in Bundesanleihen und US-Staatsanleihen geparkt. US-Dollar-Positionen werden prinzipiell gegen Euro abgesichert.

Mit dieser Strategie konnte der Greiff Systematic Allocation in der Spitze rund 12 Prozent\* erwirtschaften. Seine erste Feuertaufe hat der Greiff Systematic Allocation bereits Ende des Jahres 2018 bestanden. Durch die Kursrückschläge an den Aktienmärkten lag die Aktienquote des Fonds Ende 2018 bei niedrigen 22 Prozent. Diese wurde im Januar 2019 sehr schnell wieder hochgefahren. Da es sich um eine regelbasierte Strategie handelt, lässt sich die Entwicklung der Aktienquote sehr gut nachvollziehen“, erläutert **Schnieder** und ergänzt: „Durch das Regelwerk sind außerdem reproduzierbare Ergebnisse zu erwarten.“

„Wir freuen uns sehr über die erfolgreiche Zusammenarbeit mit unserem Partner Greiff capital management“, sagt **Monega-Geschäftsführer Bernhard Fünfer**. Der Greiff Systematic Allocation gehört zu den inzwischen mehr als 40 Partnerfonds, die Monega zu spezialisierten Anlagethemen mit ausgewählten Fondspartnern für bestimmte Kundengruppen auflegt und auf ihrer KVG-Plattform verwaltet.

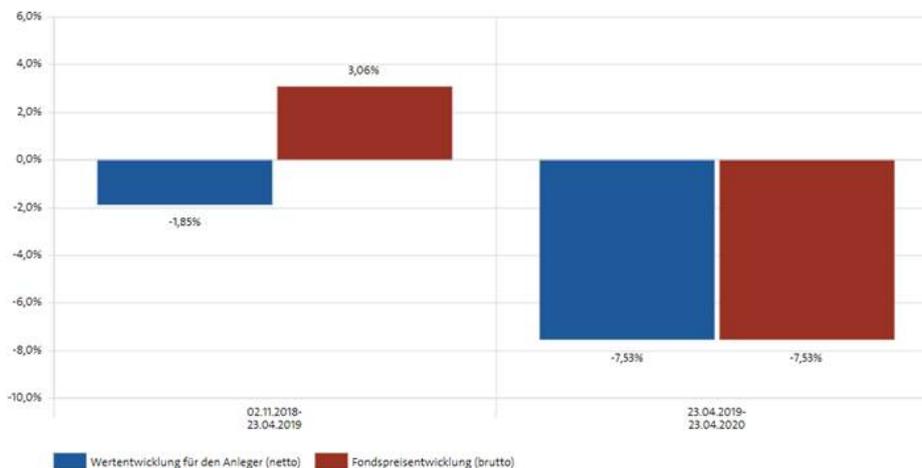
#### KURZPORTRAIT Greiff Systematic Allocation

- ISIN DE000A2JN5C2 (R-Tranche) / DE000A2JN5B4 (I-Tranche)
- Regelbasierter Aktienfonds, der auf einer automatisierten Analyse von Aktien (EURO STOXX, S&P 500, S&P 400) anhand charttechnischer Formationen basiert
- Auflegung: 02.11.2018
- Fondswährung: EUR
- Gewinnverwendung: ausschüttend

#### Indexierte Wertentwicklung seit Auflegung (bis 23.04.2020)



#### Historische Wertentwicklung Stand: (bis 23.04.2020)



Die obige Darstellung zeigt die Wertentwicklung der R-Tranche. Die Wertentwicklung der I-Tranche des Fonds können Sie dem tagesaktuellen Fact Sheet auf [www.monega.de](http://www.monega.de) entnehmen.

KURZPORTRAIT Greiff Systematic Allocation - Fortsetzung -	
▪	Geschäftsjahresende: 31.10.
▪	Ausgabeaufschlag: z.Zt. 3,00 %, max. 5,00 % (R-Tranche) / z.Zt. 0,00 %, max. 0,00 % (I-Tranche)
▪	Verwaltungsvergütung: z.Zt. 1,45 % p.a., max. 1,50 % (R-Tranche) / z.Zt. 1,00 % p.a., max. 1,00 % p.a. (I-Tranche)
▪	Performanceabhängige Vergütung: keine
▪	Verwahrstellenvergütung: z.Zt. 0,04 % p.a., max. 1,00 % p.a. (R-Tranche) / z.Zt. 0,04 % p.a., max. 1,00 % p.a. (I-Tranche)
▪	Verwahrstelle: Kreissparkasse Köln
▪	Gesamtkostenquote (TER)**: 1,89 % (R-Tranche) / 1,18 % (I-Tranche)
▪	Kapitalverwaltungsgesellschaft: Monega Kapitalanlagegesellschaft mbH
▪	Fondsmanagement: Greiff capital management AG

\*\* Geschäftsjahr 02.11.2018-31.10.2019. Die Gesamtkostenquote (Total Expense Ratio) gibt die Aufwendungen insgesamt (mit Ausnahme der Transaktionskosten) bezogen auf das durchschnittliche Fondsvermögen innerhalb des letzten Geschäftsjahres an.

CHANCEN	RISIKEN
<ul style="list-style-type: none"> <li>• Langfristig ist der Vermögensaufbau mit Aktien jeder anderen Geldanlage überlegen. Aktienanlagen sollten daher in keinem</li> <li>• Risikostreuung durch Investition in einen breit diversifizierten Fonds mit vermögensverwaltendem Charakter.</li> <li>• Automatische Ausrichtung der Wertpapieraufteilung in Aktien und Rentenpapiere gemäß der aktuellen Marktsituation.</li> <li>• In guten Börsenzeiten nimmt der Anleger mit bis zu 100% Aktienanteil am Aufschwung der Märkte teil.</li> <li>• In schlechten Börsenzeiten wird eine reduzierte Aktienquote zugunsten einer erhöhten Rentenquote angestrebt, um Verlustphasen zu reduzieren.</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Aktienrisiko: Aktien unterliegen erfahrungsgemäß starken Kursschwankungen und somit auch dem Risiko von Kursrückgängen.</li> <li>• Zinsänderungsrisiko: Mit der Investition in festverzinsliche Wertpapiere ist das Risiko verbunden, dass sich das Marktzinsniveau während der Haltezeit der Papiere verändert.</li> <li>• Kapitalmarktrisiko: Die Kurs- oder Marktwertentwicklung von Finanzprodukten hängt insbesondere von der Entwicklung der Kapitalmärkte ab, die von der allg. Lage der Weltwirtschaft sowie wirtschaftlichen und politischen Rahmenbedingungen in den jeweiligen Ländern beeinflusst wird.</li> <li>• 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.</li> <li>• Adressenausfallrisiko: Durch den Ausfall eines Ausstellers oder eines Vertragspartners, gegen den der Fonds Ansprüche hat, können für den Fonds Verluste entstehen.</li> <li>• Derivaterisiko: Der Fonds setzt Derivate sowohl zu Investitions- als auch zu Absicherungszwecken ein. Die erhöhten Chancen gehen mit erhöhten Verlustrisiken einher.</li> </ul>

**Über Monega KAG:**

Die konzernunabhängige Monega Kapitalanlagegesellschaft mbH hat ihren Sitz in Köln und wurde im Jahr 1999 gegründet. Ihre Gesellschafter sind die DEVK Rückversicherungs- und Beteiligungs-AG (45 %), die MoBet Beteiligungsgesellschaft mbH (45 %) sowie die Sparda-Bank West e.G. (10 %). Als mittelständisches Unternehmen sind für Monega Kundennähe, kurze und unbürokratische Prozesse, Flexibilität und hohe Innovationsgeschwindigkeit selbstverständlich. Das Spektrum der angebotenen Fonds umfasst Aktien-, Renten- und geldmarktnahe Fonds bis hin zu Multi-Asset und Kreditfonds. Darüber hinaus verwaltet Monega auf besondere Anlagethemen spezialisierte Publikumsfonds, so genannte Partnerfonds, die sie gemeinsam mit den Fondspartnern für ausgewählte Kundengruppen auflegt. Aktuell verwaltet Monega ein Fondsvermögen von rund 6,1 Milliarden Euro in Publikums- und Spezialfonds sowie im Rahmen der Finanzportfolioverwaltung bei anderen Kapitalverwaltungsgesellschaften.

**Über die Greiff capital management AG:**

Die Greiff capital management AG mit Sitz in Freiburg im Breisgau wurde von CEO Volker Schilling und dem Aufsichtsratsvorsitzenden Edgar Mitternacht sowie einigen ausgewählten Partnern in 2005 gegründet. Gegenstand des Unternehmens ist die Beratung institutioneller Kapitalanleger und das Management von unigen Investmentfonds.

**Disclaimer:**

Die Inhalte dieser Pressemitteilung stellen keine Handlungsempfehlung dar, sondern dienen der werblichen Darstellung. 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 aktuellen Verkaufsprospektes, der aktuellen Jahres- und Halbjahresberichte und der wesentlichen Anlegerinformationen (wAI), die kostenlos auf der Homepage der Gesellschaft unter [www.monega.de](http://www.monega.de) abgerufen oder von der Gesellschaft in gedruckter Form über die Adresse Monega Kapitalanlagegesellschaft mbH, Stolkgasse 25-45, 50667 Köln bezogen werden können. Diese Pressemitteilung wurde mit Sorgfalt entworfen und hergestellt, dennoch übernimmt die Gesellschaft keine Gewähr für die Aktualität, Richtigkeit und Vollständigkeit. Stand aller Informationen, Darstellungen und Erläuterungen ist April 2020, soweit nicht anders angegeben.

---

**Pressekontakt:**

eyetoeye PR Consulting & Communication, Kathrin Lochmüller, im LUXX-Haus, Radilostraße 43, 60489 Frankfurt, Tel. 069/24747100-21, Fax: -19, Mobil 0172/9998053, E-Mail: [kl@eyetoeye-pr.de](mailto:kl@eyetoeye-pr.de);  
Monega Kapitalanlagegesellschaft mbH, Katharine Trimpop, Stolkgasse 25-45, 50667 Köln, Tel.: 0221/39095-139, E-Mail: [katharine.trimpop@monega.de](mailto:katharine.trimpop@monega.de), Internet: [www.monega.de](http://www.monega.de)