

Marketinginformationen

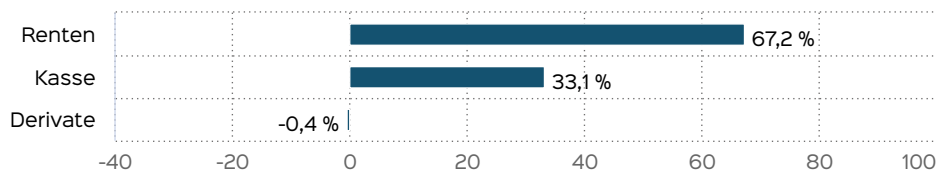
Fondsportrait

Das Anlageziel besteht in der Erzielung von kontinuierlichen Erträgen, die nicht mit einer Benchmark (z. B. einem Aktienindex) oder der aktuellen Marktphase korrelieren.

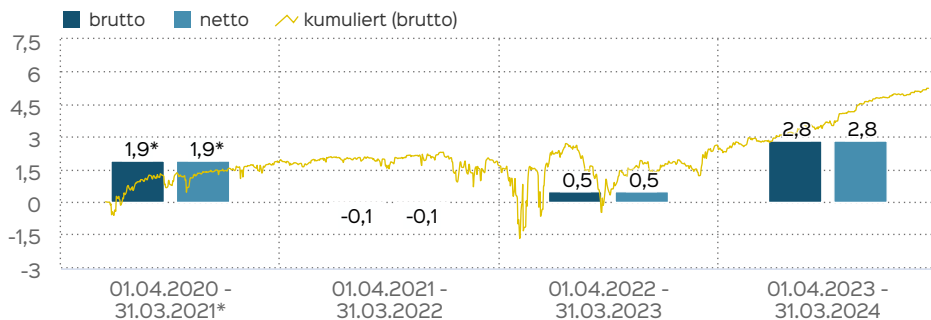
Der Gamma Fonds besteht aus einem Basisportfolio aus Anleihen und Fest- und Termingeldern, sowie einem Derivate-Portfolio als hauptsächlichen Renditeträger. Das Derivate-Portfolio besteht überwiegend aus gekauften (Long) und verkauften (Short) Optionen auf europäische und nordamerikanische Aktienindizes. Merkmal der Anlagestrategie ist, dass stets versucht wird mehr Long als Short Optionen im Portfolio zu halten, und dabei einen Prämienüberschuss zu erzielen.

Um das Ziel der Prämieinnahme zu erreichen, folgt der Anlageprozess einem eigens dafür entwickelten quantitativen Konzept. Der gesamte Investmentprozess erfolgt regelbasiert. Die Umsetzung erfolgt diskretionär. Ziel des Prämienüberschusses ist es, einen mit der tatsächlichen Marktphase weitestgehend unkorrelierten Ertragsstrom zu generieren (Absolute Return Gedanke). Ziel des Überhangs an Long Optionen ist es, bei starken Markteinbrüchen einen gewissen Schutz gegen Verluste im Fondswert zu haben. Und darüber hinaus sogar die Möglichkeit zu besitzen, bei Markteinbrüchen zusätzliche Erträge zu erwirtschaften. Des Weiteren wird aktives Risikomanagement betrieben, um das Risiko so gering wie möglich zu halten. Das Portfolio wird laufend gescreent und bewertet. Sobald die Risikokennziffern nicht mehr im Gleichgewicht sind, erfolgt ein regelbasierter Absicherungsmechanismus.

Vermögensaufteilung



Wertentwicklung in 12-Monats-Perioden



Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung. Alle Wertentwicklungen gehen von einer Wiederanlage der Ausschüttungen und einem Anlagebetrag von 1.000.000 EUR aus und umfassen jeweils zwölf Monate. Die mit einem * gekennzeichneten Werte beziehen sich auf einen kürzeren Zeitraum (seit Auflegung). Nettowertentwicklung: Neben sämtlichen im Fonds anfallenden Kosten wird auch der jeweilige Ausgabeaufschlag berücksichtigt. Dieser wird zu Beginn des dargestellten Wertentwicklungszeitraumes vom Anlagebetrag abgezogen. Der Rücknahmeabschlag, sofern ein solcher erhoben wird, wird bei der Rückgabe der Fondsanteile abgezogen. Eine eventuell anfallende, die Wertentwicklung mindernde Depotgebühr bleibt außer Betracht. Bruttowertentwicklung: Entspricht der Nettowertentwicklung, berücksichtigt aber keinen Ausgabeaufschlag.

Fondsprofil

| | |
|----------------------------|--|
| Fondsname | Gamma Plus |
| Anteilschein-klasse | I |
| ISIN | DE000A2PYPU8 |
| WKN | A2PYPU |
| Auflegungsdatum | 15.06.2020 |
| Gesamtfondsvermögen | 70,41 Mio. EUR |
| NAV | 105,07 EUR |
| Ausgabepreis | 105,07 EUR |
| Rücknahmepreis | 105,07 EUR |
| Fondswährung | EUR |
| Aktives Management | ja |
| Ausgabeaufschlag | 0,00 % |
| Rücknahmeabschlag | 0,00 % |
| Geschäftsjahresende | 31. Mai |
| Ertragsverwendung | Thesaurierung |
| TER (= Laufende Kosten) | 1,09 % |
| Verwaltungsvergütung | davon 1,00 % p.a. |
| Verwahrstellenvergütung | davon 0,10 % p.a. |
| Erfolgsabhängige Vergütung | Ja, im letzten Geschäftsjahr 0,05 % (Details siehe "Wichtige Hinweise"). |
| VL-fähig | nein |
| Sparplanfähig | nein |
| Einzelanlagefähig | nein |
| Vertriebszulassung | DE |
| Cut-off time | 16:00 Uhr |

Ratings & Rankings

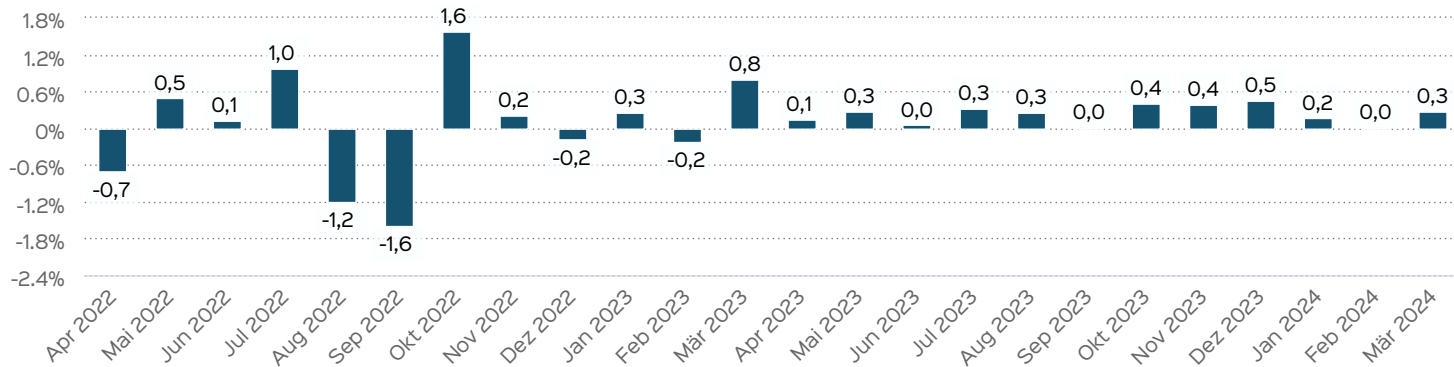
| | |
|-------------------------|-----------|
| ESG Rating | AA |
| ESG Score | 8,58 |
| ESG-Kategorie gem. SFDR | Artikel 8 |

Das ESG Rating wurde auf Basis von MSCI ESG bereitgestellter Daten entwickelt und berechnet.

Wertentwicklung auf Monatsbasis

Alle Angaben in Prozent

| Jahr | Jan | Feb | Mär | Apr | Mai | Jun | Jul | Aug | Sep | Okt | Nov | Dez | Wertentwicklung KJ |
|------|-------|-------|------|-------|------|------|------|-------|-------|------|------|-------|--------------------|
| 2022 | -0,82 | 0,16 | 0,20 | -0,71 | 0,48 | 0,13 | 0,96 | -1,21 | -1,59 | 1,59 | 0,22 | -0,18 | -0,80 |
| 2023 | 0,26 | -0,22 | 0,81 | 0,15 | 0,28 | 0,05 | 0,33 | 0,26 | 0,02 | 0,41 | 0,39 | 0,46 | 3,23 |
| 2024 | 0,17 | 0,02 | 0,28 | | | | | | | | | | 0,32 |



Die frühere Wertentwicklung lässt nicht auf zukünftige Renditen schließen.

Risiko- und Ertragsprofil

< Geringeres Risiko

Höheres Risiko >



< Potenziell geringerer Ertrag

Potenziell höherer Ertrag >

Empfohlener Anlagehorizont



Hinweis

Der Gesamtrisikoindikator hilft Ihnen, das mit diesem Produkt verbundene Risiko im Vergleich zu anderen Produkten einzuschätzen. Er zeigt, wie hoch die Wahrscheinlichkeit ist, dass Sie bei diesem Produkt Geld verlieren, weil sich die Märkte in einer bestimmten Weise entwickeln oder wir nicht in der Lage sind, Sie auszubezahlen. Wir haben dieses Produkt auf einer Skala von 1 bis 7 in die Risikoklasse 3 eingestuft, wobei 3 einer mittelniedrigen Risikoklasse entspricht. Das Risiko potenzieller Verluste aus der künftigen Wertentwicklung wird als mittelniedrig eingestuft. Bei ungünstigen Marktbedingungen ist es unwahrscheinlich, dass die Fähigkeit beeinträchtigt ist, Ihr Rückgabeverlangen auszuführen.

Weitere Informationen zu den Risiken finden Sie in dem Dokument: Wesentliche Anlegerinformationen

Empfehlung

Der Risikoindikator beruht auf der Annahme, dass Sie das Produkt 5 Jahre halten. Wenn Sie die Anlage frühzeitig einlösen, kann das tatsächliche Risiko erheblich davon abweichen und Sie erhalten unter Umständen weniger zurück.

Kennzahlen

| | |
|--------------------------------|---------|
| Mod. Duration | 0,85 |
| Duration | 0,88 |
| LiquidityRatio | 1,00508 |
| durchschnittliche Restlaufzeit | 0,86 |
| Investitionsgrad | 66,88 % |
| Dauer des Verlustes in Tagen | 184 |
| Sharpe Ratio | -0,15 |
| Volatilität | 3,15 % |
| Max Drawdown | -3,89 % |
| Drawdown | -0,22 % |
| Anzahl negativer Monate | 9 |
| Anzahl positiver Monate | 27 |
| Anteil positiver Monate | 75 % |
| Schlechtester Monat | -1,59 % |
| Bester Monat | 1,59 % |

Top Wertpapiere

| | |
|---------------------------|---------|
| KRED.F.WIED.22/25 MTN | 20,53 % |
| KRED.F.WIED.19/24 MTN | 7,04 % |
| RHEINL.PF.SCHATZ.V.2022 | 6,88 % |
| NRW.BANK IS.A.18E 17/25 | 6,85 % |
| K.F.W.ANL.V.15/2025 | 4,18 % |
| BERLIN, LAND LSA15/25A459 | 3,33 % |
| BERLIN, LAND LSA15/25A465 | 2,76 % |
| BREMEN LSA 196 | 2,53 % |
| EMIKON BL 4 46 LSA 14/24 | 2,40 % |
| NIEDERS.SCH.A.16/24 A.864 | 2,11 % |

Fondspartner-Beschreibung

Die LeanVal Asset Management AG wurde 1991 gegründet und versteht sich heute als hochspezialisierter Anbieter von Absolute Return Produkten. Unsere Kernkompetenzen konzentrieren sich auf die Verwaltung von Benchmark unabhängigen Strategien mit Fokus auf liquide, börsengehandelte Finanzinstrumente. So bieten wir unseren Kunden neben Absolute Return in nahezu jedem Marktumfeld einen zusätzlichen Nutzen hinsichtlich Diversifikation und Unabhängigkeit.

- Wir unterscheiden uns von den großen Investmentfirmen bezüglich Flexibilität, Individualität und Kontinuität.

- Wir legen größten Wert auf langfristige Kundenbeziehungen, die geprägt sind durch transparente Kommunikation. Der Finanzportfolioverwalter LVAM AG versteht es seinen institutionellen Kunden einen individualisierten, auf die Bedürfnisse zugeschnittenen Beratungs- und Betreuungsansatz zu bieten.
- Die LeanVal Asset Management AG verwaltet mehrere hundert Millionen Euro in Alternativen Anlagen. Die führenden Mitarbeiter der LVAM sind maßgeblich am Unternehmenserfolg beteiligt.

Wichtige Hinweise

Quelle aller Daten, sofern nicht anders angegeben: HANSAINVEST.

Dies sind Marketinginformationen. Bitte lesen Sie den [Verkaufsprospekt](#) und das [Basisinformationsblatt](#) bevor Sie eine endgültige Anlageentscheidung treffen. Grundlage für den Kauf sind die jeweils gültigen Verkaufsunterlagen, die ausführliche Hinweise zu den einzelnen mit der Anlage verbundenen Risiken enthalten. Der Verkaufsprospekt und die wesentlichen Anlegerinformationen sind ausschließlich in deutscher Sprache in elektronischer Form erhältlich. Auf Wunsch senden wir Ihnen Druckstücke kostenlos zu.

Der Nettoinventarwert von Investmentfonds unterliegt in unterschiedlichem Maße Schwankungen und es gibt keine Garantie dafür, dass die Anlageziele erreicht werden. Es besteht die Gefahr, dass der Anleger durch den Erwerb der Anlage einen finanziellen Verlust erleidet.

Mit dem Erwerb der beworbenen Anlage erwirbt der Anleger lediglich Anteile an einem Fonds und nicht die im Fonds enthaltenen Basiswerte, wie z.B. ein Gebäude oder die Aktie eines Unternehmens.

Die Wertentwicklung wird nach der [BVI-Methode](#) ermittelt. Informationen zur genauen Berechnungsweise der Wertentwicklungen erhalten Sie im Internet unter [Rechenartenbeschreibung](#). Die zukünftige Wertentwicklung unterliegt der Besteuerung. Diese ist von der persönlichen Situation des jeweiligen Anlegers abhängig und kann sich in der Zukunft ändern.

Das Gesamtfondsvermögen bezieht sich auf das Fondsvermögen aller zum Fonds zugehörigen Anteilsklassen. Dabei wird das Gesamtfondsvermögen in der Währung der Anteilsklasse ausgewiesen, die als erstes aufgelegt wurde.

Die angegebenen laufenden Kosten (Gesamtkostenquote) fielen im letzten Geschäftsjahr des Sondervermögens an; bei neu aufgelegten Fonds handelt es sich um eine Schätzung für das erste Geschäftsjahr. Die anfallenden Kosten können von Jahr zu Jahr schwanken und verringern die Ertragschancen des Anlegers. Nähere Informationen zu den Kosten und zu einer etwaigen Erfolgsvergütung und deren Zusammensetzung sind aus den wesentlichen Anlegerinformationen zu entnehmen.

Bei einer Investition in den Fonds Gamma Plus I fällt eine Performancefee für den Anleger an, wenn die Wertsteigerung des Fonds Gamma Plus I, die festgelegte Geldmarktanlage als Vergleichsmaßstab, übersteigt. Die Performancefee wird folgendermaßen berechnet und verringert die positive Wertentwicklung des Anlegers. 15 % des Betrages, um den die Anteilswertentwicklung am Ende einer Abrechnungsperiode den Ertrag aus einer als Vergleichsmaßstab herangezogenen Geldmarktanlage in dieser Abrechnungsperiode übersteigt, jedoch insgesamt höchstens bis zu 15 % des Durchschnittswerts in der Abrechnungsperiode. Eine negative Wertentwicklung muss aufgeholt werden.

Die in den gegebenenfalls dargestellten Anlagestrukturen oder Vermögensaufteilungen angegebenen Prozentwerte beziehen sich generell auf das gesamte Fondsvermögen. Für die Darstellung einzelner Strukturen wird jeweils nur eine Teilmenge der Vermögensarten als Basis verwendet (z.B. bei Branchen nur der Aktienanteil), so dass in der Summe nicht zwingend 100% erreicht werden.

Die Darstellung der Top Wertpapiere (sofern angezeigt) erfolgt für maximal 60% des Fondsvermögens.

Bei den dargestellten Werten handelt es sich um gerundete Werte, so dass die Summe der Werte von 100 % abweichen kann.

Die Cut-off time bezeichnet den täglichen Orderannahmeschluss der Verwahrstelle des Fonds. Sie wird bei der depotführenden Stelle des Anlegers regelmäßig früher liegen.

Dieses Dokument und die in ihm enthaltenen Informationen richten sich nicht an US-Personen und dürfen nicht in den USA verbreitet werden.

Eine Zusammenfassung der Anlegerrechte in deutscher Sprache können Sie auf unserer Website unter [Compliance](#) erhalten.

Der Vertrieb des Fonds kann jederzeit in Übereinstimmung mit den Vorschriften des KAGB widerrufen werden.

Wertentwicklung in Perioden

| | kumuliert | p.a. |
|----------------|-----------|--------|
| laufendes Jahr | 0,32 % | |
| 1 Monat | -0,02 % | |
| 3 Monate | 0,25 % | |
| 6 Monate | 1,38 % | |
| 1 Jahr | 2,54 % | 2,54 % |
| 3 Jahre | 3,15 % | 1,04 % |
| 5 Jahre | | |
| 10 Jahre | | |
| seit Auflegung | 5,07 % | 1,30 % |

Die frühere Wertentwicklung lässt nicht auf zukünftige Renditen schließen.

Kontakt: Fondsmanager

Markus Buchmann
 LeanVal Asset Management AG
 Bleichstraße 52
 60313 Frankfurt am Main
 Telefon: +49 69 949488024
 Telefax: +49 69 949488010
 E-Mail: markus.buchmann@lvam.de
 Internet: <https://www.lvam.de>

Kontakt: Vertriebspartner

LeanVal Asset Management AG
 Bleichstraße 52
 60313 Frankfurt am Main
 Deutschland
 Telefon: +49 (0)69 949488 040
 Telefax: +49 (0)69 949488 010
 E-Mail: info@lvam.de
 Internet: <https://www.lvam.de>

Verwaltungsgesellschaft

HANSAINVEST
 Hanseatische Investment-GmbH
 Kapstadtring 8
 22297 Hamburg
 Telefon: +49 (0)40 3 00 57 - 0
 Telefax: +49 (0)40 3 00 57 - 60 70
 E-Mail: service@hansainvest.de
 Internet: <https://www.hansainvest.com>