



# Persephone Cointegration Alpha

**KATEGORIE:** Aktienfonds  
Angaben per 22. September 2022

Seite 1/3

## Fondsbeschreibung

Der Persephone Cointegration Alpha Fonds verfolgt eine reine Alpha Strategie. Dafür werden mindestens 51 Prozent des Fondsvermögens in Aktien europäischer Aussteller investiert, deren Auswahl und Gewichtung quantitativ und prognosefrei unter Anwendung des mathematischen Konzepts der Co-Integration erfolgt. Die Marktrendite (Beta) wird mittels börsengehandelter Derivate gesichert.



## Indexierte Wertentwicklung seit Auflegung

Eine Darstellung erfolgt erstmals nach 12 Monaten

## FONDSBERATER

Persephone Quantitative Finance Group GmbH

## Risiko - Ertragsprofil



← Geringes Risiko → Hohes Risiko →  
← Geringere Rendite → Relativ hohe Rendite →

Der Persephone Cointegration Alpha ist in Kategorie 4 eingestuft, weil sein Anteilspreis typischerweise moderat schwankt und deshalb sowohl Verlustrisiken wie Gewinnchancen entsprechend moderat sind.

## Anlagehorizont



Der Fonds eignet sich für Kunden mit einem Anlagehorizont von 5 Jahren oder länger.

## Risikokennzahlen

VOLATILITÄT <sup>1</sup> (SEIT AUFLAGE)	+4,63 %
SHARPE RATIO <sup>2</sup> (SEIT AUFLAGE)	-2,25
MAX. DRAWDOWN <sup>3</sup> (SEIT AUFLAGE)	-6,51 %
VALUE AT RISK <sup>4</sup> (99% / 10 TAGE)	n.v.

1) Die Kennziffer bezeichnet das "Schwankungsrisiko" des Fonds und ist Maß der Intensität von Schwankungen der Fondsperformance um ihren erwarteten Mittelwert.

2) Die Sharpe Ratio ist die Differenz zwischen erzielter Performance p.a. und risikolosem Zins p.a., dividiert durch die Volatilität. Sie lässt sich daher als „Risikoprämie pro Einheit am eingegangenen Gesamtrisiko“ interpretieren.

3) Der Maximum Drawdown gibt den maximalen kumulierten Verlust an, den ein Anleger innerhalb eines Betrachtungszeitraums hätte erleiden können. Die Länge des Drawdowns ist die Zeitspanne vom Beginn der Verlustperiode bis zum Erreichen des Tiefstkurses.

4) Der Value at Risk (ex post) ist der maximal mögliche Verlust des Fonds bei gegebener Haltedauer und Konfidenzniveau abgeleitet auf der Basis der Standardabweichung der Fondsreturns.



## Persephone Cointegration Alpha

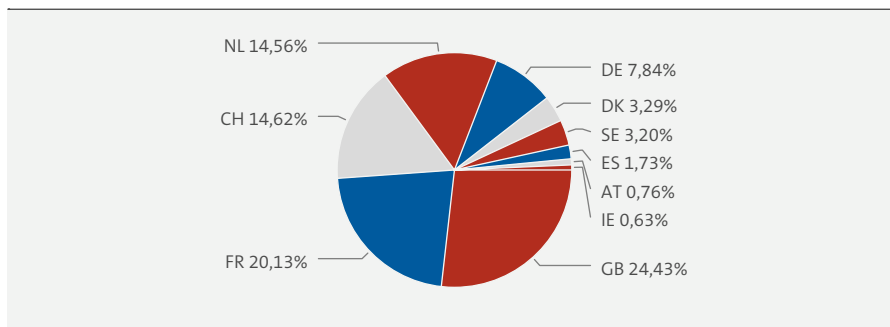
**KATEGORIE:** Aktienfonds  
Angaben per 22. September 2022

Seite 2/3

### Die größten Positionen in Prozent des Fondsvermögens (31.08.2022)

Name	Land	% des Vermögens
1. Diageo plc	Großbritannien	4,69%
2. Total SA	Frankreich	4,67%
3. Reg Shs Shell PLC	Niederlande	3,73%
4. AstraZeneca PLC	Großbritannien	3,70%
5. Novartis AG	Schweiz	3,68%
6. ASML Holding NV	Niederlande	3,31%
7. HSBC Holdings plc	Großbritannien	3,14%
8. Nestle S.A.	Schweiz	3,02%
9. Sartorius Stedim Biotech S.A. Actions Port. EO -,166667	Frankreich	2,98%
10. ASM International N.V.	Niederlande	2,86%

### Länder (31.08.2022)



### Verteilung nach Branchen

Gesundheit / Pharma	17,59%
Nahrungsmittel und Tabak	11,88%
Energie	10,73%
Privater Konsum und Haushalt	8,71%
Finanzdienstleister	7,29%
Technologie	7,25%
Versicherungen	6,76%
Versorger	5,44%
Industrie	5,29%
Banken	4,57%

### Fondsdetails

Stammdaten	
AUFLAGEDATUM	15.03.2022
WKN	A3CQVR
ISIN	DE000A3CQVR4
FONDSWÄHRUNG	EUR
GESCHÄFTSJAHESENDE	28.02.
ERTRAGSVERWENDUNG	ausschüttend
FONDSVERMÖGEN	9,43 Mio. EUR
RÜCKNAHMEPREIS	94,29 EUR
AUSGABEPREIS	94,29 EUR
VERWAHRSTELLE	
	Kreissparkasse Köln
FONDSGESELLSCHAFT	Monega KAG
FONDSBERATER	Monega KAG
KATEGORIE GEM. OFFVO	Artikel 6
Fondskonditionen	
AUSGABEAUFSCHLAG Z.ZT.	0,00% (MAX. 2,50%) (Hiervon erhält Ihre Vertriebsorganisation bis zu 100%)
VERWALTUNGS-VERGÜTUNG P.A. Z.ZT.	0,900%(MAX. 1,100%)
VERWAHRSTELLEN-VERGÜTUNG P.A. Z.ZT.	0,040%(MAX. 0,04%)
VERWAHRSTELLE MINDESTGEBÜHR P.A.	10.000 EUR
GESAMTKOSTENQUOTE (TER) <sup>1</sup>	1,23%
PERFORMANCE FEE	keine
MINDESTERSTANLAGE <sup>2</sup>	100.000,00 EUR
MINDESTFOLGEANLAGE <sup>2</sup>	keine
SPARPLANFÄHIGKEIT	nein
ORDERSCHLUSSZEITEN	10:30 tgl. für tgl.
VL-FÄHIGKEIT	nein

1) Die Gesamtkostenquote (Total Expense Ratio) gibt die vom Fonds getragenen Kosten insgesamt (mit Ausnahme der Transaktionskosten und der Performance Fee) bezogen auf das durchschnittliche Fondsvermögen innerhalb des letzten Geschäftsjahres an.

1b.) Bei den hier angegebenen laufenden Kosten handelt es sich, mangels Vorliegen konkreter historischer Daten, um eine Kostenschätzung.

2) Ergänzend gelten die jeweiligen Bedingungen der Depotstelle oder Ihrer Hausbank.



## Persephone Cointegration Alpha

**KATEGORIE:** Aktienfonds  
Angaben per 22. September 2022

Seite 3/3

### + CHANCEN

### i RISIKEN

- Aktienrisiko: Aktien unterliegen erfahrungsgemäß starken Kursschwankungen und somit auch dem Risiko von Kursrückgängen.
- Zinsänderungsrisiko: Mit der Investition in festverzinsliche Wertpapiere ist das Risiko verbunden, dass sich das Marktzinsniveau während der Haltezeit der Papiere verändert.
- 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 Verluste 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.

### KONTAKT

Monega KAG  
Stolkgasse 25-45  
50667 Köln  
Tel.: 0221-39095 0  
Fax: 0221-39095 400  
Website: [www.monega.de](http://www.monega.de)  
E-Mail: [info@monega.de](mailto:info@monega.de)

### FONDSBERATER

Monega KAG  
Stolkgasse 25-45  
50667 Köln  
Tel.: 0221-39095 0  
Fax: 0221-39095 400  
Website: [www.monega.de](http://www.monega.de)  
E-Mail: [info@monega.de](mailto:info@monega.de)

### MARKETING

Persephone Quantitative Finance Group  
GmbH  
Wilhelm-Leuschner-Straße 82  
60329 Frankfurt am Main  
Tel.: +49 69 2100 7744  
Fax: +49 69 2100 7775  
Website: [www.persephone.finance](http://www.persephone.finance)  
E-Mail: [info@persephone-finance.com](mailto:info@persephone-finance.com)

**DISCLAIMER:** © 2022 Monega Kapitalanlagegesellschaft mbH. Diese Publikation ist kein Verkaufsprospekt im Sinne des Gesetzes, sondern eine werbliche Darstellung und dient der weiterführenden Information. Sie stellt keine Handlungsempfehlung dar und ersetzt nicht die individuelle Anlageberatung durch eine Bank/einen Vertriebspartner sowie den steuerlichen oder rechtlichen Rat. Der Verkauf von Anteilen erfolgt ausschließlich auf der Grundlage des aktuellen Verkaufsprospektes und der wesentlichen Anlegerinformationen. Diese sowie die aktuellen Jahres- und Halbjahresberichte erhalten Sie kostenlos in deutscher Sprache bei der Monega Kapitalanlagegesellschaft mbH, Stolkgasse 25-45, 50667 Köln, und im Internet auf [www.monega.de](http://www.monega.de). Im Verkaufsprospekt sind Anlageziele, Gebühren, Risiken und andere wichtige Fondsinformationen ausführlich beschrieben. Bitte lesen Sie diese sorgfältig durch.

Die enthaltenen Aussagen zur Marktlage stellen unsere eigene Ansicht der geschilderten Umstände dar. Hiermit ist weder eine Allgemeingültigkeit noch eine Anlageberatung oder -empfehlung verbunden. Die Publikation darf nicht als Verkaufsangebot oder als Aufforderung zur Abgabe eines Angebots zum Kauf von Wertpapieren verstanden werden und ersetzt in keinem Fall die vor jeder Wertpapierkaufentscheidung notwendige Beratung. Die in der Publikation gemachten Aussagen können ohne Vorankündigung geändert werden. Trotz sorgfältiger Auswahl der Quellen und Prüfung der Inhalte übernimmt Monega Kapitalanlagegesellschaft mbH keine Haftung oder Garantie für die Richtigkeit und Vollständigkeit der in dieser Publikation gemachten Informationen.

Eine Zusammenfassung Ihrer Anlegerrechte in deutscher Sprache und weitere Informationen zu Instrumenten der kollektiven Rechtsdurchsetzung erhalten Sie auf [www.monega.de/beschwerde](http://www.monega.de/beschwerde). Die Verwaltungsgesellschaft des Investmentfonds kann jederzeit beschließen den Vertrieb zu widerrufen.

Risikohinweis: Investmentfonds unterliegen dem Risiko sinkender Anteilspreise, da sich Kursrückgänge bei den im Fonds enthaltenen Wertpapieren beziehungsweise den zugrunde liegenden Währungen im Anteilspreis widerspiegeln. Die Anlagestrategie des Fonds kann sich innerhalb der vertraglich und gesetzlich zulässigen Grenzen jederzeit ändern. Der Inhalt der Grenzen ergibt sich aus dem Verkaufsprospekt.

Morningstar-Rating: © 2022 Morningstar, Inc. Alle Rechte vorbehalten. Die hierin enthaltenen Informationen: (1) sind für Morningstar und/oder ihre Inhalte-Anbieter urheberrechtlich geschützt; (2) dürfen nicht vervielfältigt oder verbreitet werden; und (3) deren Richtigkeit, Vollständigkeit oder Aktualität wird nicht garantiert. Weder Morningstar noch deren Inhalte-Anbieter sind verantwortlich für etwaige Schäden oder Verluste, die aus der Verwendung dieser Informationen entstehen.