



## Neu: Wallrich AI Peloton

### Die Prämienstrategie – ein langfristig bewährtes Erfolgskonzept

Gewinne erzielen in steigenden, stagnierenden und sogar leicht fallenden Aktienmärkten. Dieses Versprechen hält der Wallrich Prämienstrategie Fonds ([WKN A0M6N1](#)) nun schon seit über einem Jahrzehnt ein. Bei stark rückläufigen Basiswertkursen können zwar Verluste entstehen, sie fallen aber geringer als bei einem Direktinvestment in das Underlying aus. Um diese Vorgaben zu erfüllen, werden bei der Prämienstrategie an der Eurex Verkaufsoptionen (Puts) verkauft und dafür Optionsprämien vereinnahmt. Zu Verlusten kann es dabei nur kommen, wenn der jeweilige Basiswert um mehr als die zuvor vereinnahmte Optionsprämie unter den Strikelevel fällt. Im Vergleich zu Aktienengagements bietet die Prämienstrategie damit die Chance auf deutlich stabilere Erträge.

### Moderne Datenanalyse gepaart mit intelligenten Computeralgorithmen

Mit dem Wallrich AI Peloton (WKN: A2JQH3) wurde zum 1. Februar 2019 nach dem Wallrich AI Libero (WKN [A2DTL2](#)) im Dezember 2017 nun bereits die zweite Fondsvariante der Prämienstrategie lanciert, die in ganz entscheidendem Maße auf den Einsatz moderner Datenanalyse-Technologien und künstlicher Intelligenz beruht. Bei beiden Investmentfonds werden die Stillhalterpositionen auf den Euro Stoxx 50 unter Berücksichtigung vergangenheitsbezogener Daten und aktueller Marktparameter mittels intelligenter Computeralgorithmen bestimmt. Durch die Analyse der erzielten Anlageergebnisse entwickelt das Programm sein Regelwerk kontinuierlich weiter. Hierfür steht auch das „AI“ (Artificial Intelligence) in den Fondsnamen.

Dabei können für beide Sondervermögen sowohl hinsichtlich der angestrebten Rendite, wie auch des maximal zu erwartenden Drawdowns, bestimmte Vorgaben gemacht werden. So sollen beim AI Peloton im langfristigen Mittel durchschnittliche Renditen von 4–5% erzielt werden. Von den Renditeerwartungen liegt der Fonds damit im „Hauptfeld“ (Peloton), während die Risikotoleranz erheblich geringer ausfällt. So hat sich in der Rückrechnung seit 2008 nur in einem Jahr eine negative Rendite ergeben. Das restliche Fondsvermögen wird größtenteils in Form jederzeit liquidierbarer Investment-Grade Anleihen gehalten.

## Neu: Wallrich AI Peloton

### Anlagestrategie

Um das Anlageziel zu erreichen, verkauft der Fonds Put-Optionen auf den Euro Stoxx 50 Index. Auf diese Weise werden kontinuierlich Prämienentnahmen generiert. Die Struktur des Optionsportfolios (Laufzeit, Basispreis, Gewichtung) wird über ein quantitatives Modell gesteuert. Der zugrundeliegende Algorithmus wurde dabei mittels moderner Datenanalyse-Technologien und künstlicher Intelligenz optimiert und schließt menschliche Emotionen aus. Vereinfacht gesagt agiert der Fonds je nach Marktlage offensiver (bei hoher impliziter Volatilität) oder defensiver. Das Fondsvermögen wird zum Großteil in auf Euro lautende Investment-Grade Bonds angelegt. Die Zielrendite des Fonds beträgt auf mittlere Sicht 4–5 % p.a.

### Chancen

Vereinnahmung von Optionsprämien, Vereinnahmung von Zinskupons, Ausnutzen von Volatilität, Sicherheitspuffer für schwierige Marktphasen.

### Risiken

Begrenzte Teilnahme an der Wertentwicklung des Aktienmarktes, allgemeine Kurs- und Währungsrisiken, Kursrückgänge am Aktienmarkt, steigende Zinsen und Creditspreads.

### Anlagehorizont

Der empfohlene Anlagehorizont beträgt mindestens 3 Jahre.

### Stammdaten

ISIN	DE000A2JQH30
WKN	A2JQH3
Auflagedatum	01.02.2019
Verwahrstelle	Donner & Reuschel
KVG	Hansainvest
Vertriebszulassung	DE, LU
Ausgabepreis	100 Euro
Ertragsverwendung	ausschüttend
Portfolioverwalter	Wallrich Asset Management AG
Mindestanlage	100 Euro
Ausgabeaufschlag	maximal 3 %
TER	ca. 1,24 %
Management-Fee	0,75 %
Performance-Fee	15 %
Sparplanfähig	Möglich

### Risiko- und Ertragsprofil

← geringes Risiko  
niedrigere Erträge

hohes Risiko  
höhere Erträge →



### Kontakt

Wallrich Asset Management AG  
Bockenheimer Landstr. 64  
60323 Frankfurt am Main  
Tel.: 069 713 799 72  
Fax: 069 713 799 74  
info@wallrich.de  
www.wallrich.de



## Neu: Wallrich AI Peloton

### Disclaimer

Quelle aller Daten, sofern nicht anders angegeben: HANSAINVEST. Diese Informationen dienen Werbezwecken. 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 unter [www.hansainvest.com](http://www.hansainvest.com) 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. Alle Wertentwicklungen gehen von einer Wiederanlage der Ausschüttungen und- sofern nicht anders angegeben - einem Anlagebetrag von 1.000,- EUR aus. Sofern nicht anders ausgewiesen, handelt es sich um Bruttowertentwicklungen (Berechnung nach der BVI-Methode). Nettowertentwicklung: Neben sämtlichen im Fonds anfallenden Kosten wird auch der jeweilige Ausgabeaufschlag berücksichtigt, der zu Beginn des hier dargestellten Wertentwicklungszeitraumes vom Anleger zu zahlen ist sowie ein ggfs. anfallender Rücknahmeabschlag (s. „Fondsprofil“). Eine eventuell anfallende, die Wertentwicklung mindernde Depotgebühr bleibt außer Betracht. Bruttowertentwicklung: Entspricht der Nettowertentwicklung, berücksichtigt aber keinen Ausgabeaufschlag und keinen ggfs anfallenden Rücknahmeabschlag. Beim Sparplan werden die monatlichen Einzahlungen zum Ausgabepreis angelegt. 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. Bei den angegebenen Laufenden Kosten (Gesamtkostenquote) handelt es sich um eine Kostenschätzung. Da der Fonds erst am 01.12.2017 aufgelegt wurde, ist eine Angabe der tatsächlichen Gesamtkostenquote nicht möglich. Die Gesamtkostenquote umfasst sämtliche im vorangegangenen Geschäftsjahr auf Ebene des Sondervermögens und auf Ebene der vom Sondervermögen gehaltenen Investmentanteile („Zielfonds“) angefallenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten). Die anfallenden Kosten können von Jahr zu Jahr schwanken und verringern die Ertragschancen des Anlegers. Es werden 10% pro Jahr der positiven Wertentwicklung über dem Referenzwert von 3Monats-Euribor zuzüglich 4% als Erfolgsvergütung berechnet. 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 10 Wertpapiere (sofern angezeigt) erfolgt für maximal 60% des Fondsvermögens. Somit können auch weniger als 10 Positionen genannt sein. Bei den dargestellten Werten handelt es sich um gerundete Werte, so dass die Summe der Werte von 100 % abweichen kann. Die anlegerbezogene Risikoklasse beruht auf einer Prognose, wie sich der Fonds unter Berücksichtigung seiner Anlageziele zukünftig entwickeln wird. Es besteht keine Garantie dafür, dass der Fonds seine Anlageziele erreicht. Die anlegerbezogene Risikoklasse weicht von dem fondsbezogenen Risikoindikator ab. Dieser beruht auf Daten der Vergangenheit und wird in den Wesentlichen Anlegerinformationen veröffentlicht. Dieses Dokument und die in ihm enthaltenen Informationen richten sich nicht an US-Personen und dürfen nicht in den USA verbreitet werden.