

Rhein Asset Management (LUX) Fund – Ethik Quant Strategiefonds (P)

WKN/ISIN: AIT6AL/LU0903532330

Dieser Fonds wird von der FRANKFURT-TRUST Invest Luxemburg AG verwaltet.

Wesentliche Anlegerinformationen

Gegenstand dieses Dokuments sind wesentliche Informationen für den Anleger über diesen Fonds. Es handelt sich nicht um Werbematerial. Diese Informationen sind gesetzlich vorgeschrieben, um Ihnen die Wesensart dieses Fonds und die Risiken einer Anlage in ihn zu erläutern. Wir raten Ihnen zur Lektüre dieses Dokuments, so dass Sie eine fundierte Anlageentscheidung treffen können.

Ziele und Anlagepolitik

Der Rhein Asset Management (LUX) Fund – Ethik Quant Strategiefonds (P) ist ein Teilfonds des Rhein Asset Management (LUX) Fund. Die Mindestanlage beträgt 100.000 Euro. Der Fonds investiert long (steigend) und short (fallend) in Einzelwerte des europäischen Aktienuniversums (DAX und EuroStoxx50). Die Signale werden quantitativ generiert. Basis des Algorithmus ist der „mean reversion“-Effekt. Steigende Positionen werden über den Kauf der Aktie umgesetzt. An fallenden Positionen wird über den Verkauf des Single-Stock-Futures (Eurex) positiv partizipiert. Sofern in schwach volatilen Phasen die Anzahl der Long-/Short-Signale auf Basis der Einzeltitel abnimmt, investiert der Fonds in den DAX-Index über entsprechende Future-Kontrakte. Bei zunehmender Volatilität reduziert das System die Index-Quote auf bis zu 0 Prozent und generiert absolute Rendite über die Long-/Short-Positionen im europäischen Aktienuniversum. Für die Steuerung der Index-Quote wird eine vorauslaufende Korrelation der Volatilitäten im Umfeld der Einzeltitel genutzt. Die Anlagen erfolgen unter

Berücksichtigung von klar definierten Nachhaltigkeitskriterien, die sich an sozialen, ökologischen und ökonomischen Faktoren orientieren und im Einklang mit christlich ethischen Wertvorstellungen stehen. Die Auswahl der einzelnen Werte und die Steuerung des Fonds beruht auf der Einschätzung des Fondsmanagers Rhein Asset Management (LUX) S.A.

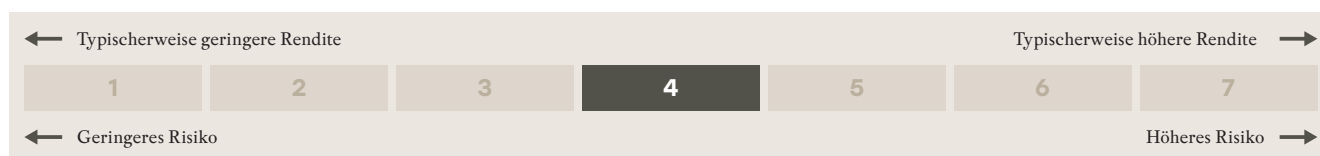
Ziel einer Anlage im Rhein Asset Management (LUX) Fund – Ethik Quant Strategiefonds (P) ist die langfristige Erwirtschaftung einer möglichst hohen Rendite.

Die Währung des Fonds ist Euro.

Die Erträge, die der Rhein Asset Management (LUX) Fund – Ethik Quant Strategiefonds (P) erwirtschaftet, werden einmal im Jahr an Sie ausgeschüttet.

Ihre Anteile am Rhein Asset Management (LUX) Fund – Ethik Quant Strategiefonds (P) können Sie börsentäglich zurückgeben.

Risiko- und Ertragsprofil



Die Einstufung des Fonds in seine Risikoklasse beruht auf historischen Daten der vergangenen 5 Jahre und stellt somit keine Vorhersage für die Zukunft dar. Die Einstufung ist keine Garantie, sie kann sich im Zeitablauf ändern. Eine Einstufung in Kategorie 1 bedeutet nicht, dass der Fonds kein Wertschwankungsrisiko hat.

Der Fonds ist in Risikoklasse 4 eingruppiert, weil die historischen Daten des Fonds bzw. die entsprechenden Index-Daten im Jahresdurchschnitt Wertschwankungen zwischen 5 und 10 % aufweisen.

Generell gilt, dass höhere Wertschwankungen größere Verlustrisiken, aber auch größere Chancen auf Wertzuwachs beinhalten.

Folgende Risiken haben auf die Einstufung keinen unmittelbaren Einfluss, können für den Fonds aber trotzdem von Bedeutung sein:

– **Operationelle Risiken einschließlich Verwahrrisiken:** Fehler und Missverständnisse bei der Verwaltung und Verwahrung können die Wertentwicklung des Fonds beeinträchtigen.

– **Modellrisiken:** Der Fonds wählt seine Anlagen auf Basis eines quantitativen Modells aus. Die Prognosekraft dieses Modells kann nachlassen.

– **Konzentrationsrisiken:** Der Fonds erwirbt Wertpapiere, die sich auf spezielle Regionen oder Themen beziehen. Deren Wertentwicklung kann beispielsweise aufgrund politischer oder wirtschaftlicher Ereignisse leiden.

– **Risiken aus dem Einsatz derivativer Instrumente:** Derivate sind Finanztermingeschäfte, die sich auf Basiswerte wie Aktien, Anleihen, Zinsen, Indizes und Rohstoffe beziehen und von deren Wertentwicklung abhängig sind. Der Fonds darf derivative Instrumente zur Absicherung oder Wertsteigerung des Fondsvermögens einsetzen. Je nach Wertentwicklung des Basiswertes können dabei Verluste entstehen.

Eine ausführliche Darstellung aller Risiken finden Sie im Verkaufsprospekt des Fonds unter „Risikohinweise“.

Kosten

Einmalige Kosten vor und nach der Anlage:	
Ausgabeaufschlag	3 %
Rücknahmeabschlag	0 %
Hierbei handelt es sich jeweils um die Höchstbeträge, die Ihnen belastet werden dürfen.	
Kosten, die dem Fonds im Verlauf des Geschäftsjahres entstehen:	
Laufende Kosten	3,11 %
Kosten, die der Fonds unter bestimmten Umständen zu tragen hat:	
Erfolgsabhängige Vergütung p. a.	
10 % des Betrages, um den die Wertentwicklung des Fonds pro Abrechnungsperiode 5 % übersteigt.	

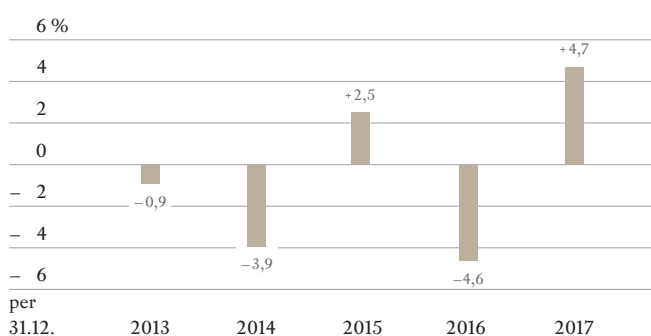
Die von Ihnen zu tragenden Kosten finanzieren die Verwaltung und Verwahrung des Fonds sowie Vertrieb und Vermarktung; diese Kosten wirken sich mindernd auf das Wachstumspotenzial Ihrer Anlage aus.

Bei den Ausgabeaufschlägen und Rücknahmeabschlägen handelt es sich jeweils um den Höchstbetrag. Im Einzelfall können die von Ihnen zu zahlenden Beträge niedriger sein. Bitte fragen Sie Ihren Berater oder Ihre Vertriebsstelle nach den tatsächlich für Sie geltenden Beträgen.

Die Kennziffer „laufende Kosten“ wurde zum letzten Geschäftsjahresende des Fonds per 31. Dezember 2017 ermittelt. Sie beinhaltet alle Kosten und sonstigen Zahlungen des Fonds (exklusive der Transaktionskosten und einer eventuellen erfolgsabhängigen Vergütung) und setzt diese in Beziehung zum Fondsvermögen. Die „laufenden Kosten“ können von Geschäftsjahr zu Geschäftsjahr schwanken.

Ausführliche Informationen zu den Kosten finden Sie im Verkaufsprospekt des Fonds.

Wertentwicklung in der Vergangenheit



Der Fonds wurde am 1. Juli 2013 aufgelegt.

Die frühere Wertentwicklung ist keine Garantie für die künftige Entwicklung des Fonds.

Die Berechnung erfolgte in der Fondswährung Euro und auf Basis des Rücknahmepreises.

Das bedeutet, alle Kosten und Gebühren des Fonds mit Ausnahme des Ausgabeaufschlags sind berücksichtigt.

Ausschüttungen bzw. abzuführende Steuern wurden wiederangelegt.

Praktische Informationen

Verwahrstelle für diesen Fonds ist die CACEIS Bank, Luxembourg Branch.

Weitere praktische Informationen zum Fonds, den Verkaufsprospekt (OGAW-Prospekt), Jahres- und Halbjahresberichte sowie die aktuellen Ausgabe- und Rücknahmepreise finden Sie kostenlos und in deutscher Sprache auf unserer Internet-Seite „www.frankfurt-trust.lu“.

Die luxemburgischen Steuervorschriften können die Besteuerung Ihrer persönlichen Einkünfte aus dem Fonds beeinflussen.

Die FRANKFURT-TRUST Invest Luxembourg AG kann lediglich auf der Grundlage einer in diesem Dokument enthaltenen Erklärung haftbar gemacht werden, die irreführend, unrichtig oder nicht mit den einschlägigen Teilen des OGAW-Prospekts vereinbar ist.

Dieser Fonds ist in Luxemburg zugelassen und wird durch die Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) reguliert. Diese wesentlichen Informationen für den Anleger sind zutreffend und entsprechen dem Stand vom 14. Februar 2018.

Einzelheiten zur aktuellen Vergütungspolitik der Gesellschaft sind im Internet unter „www.frankfurt-trust.lu“ veröffentlicht. Hierzu zählen eine Beschreibung der Berechnungsmethoden für Vergütungen und Zuwendungen an bestimmte Mitarbeitergruppen sowie die Angabe der für die Zuteilung zuständigen Personen. Auf Verlangen werden die Informationen von der Gesellschaft kostenlos in Papierform zur Verfügung gestellt.