

LIMMAT CAPITAL – LC Equity Strategy

Nur für qualifizierte Investoren

Strategie AuM¹ USD 117 m
Firma AuM¹ USD 314 m

Eine opportunistische Tradingstrategie mit Fokus auf liquide europäische Aktien und Futures

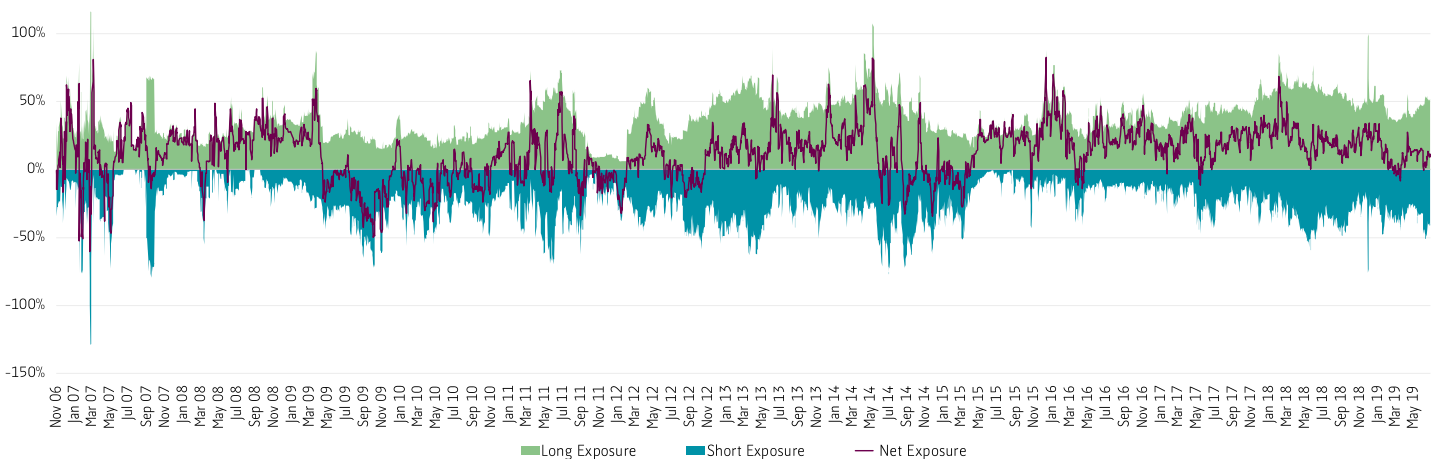
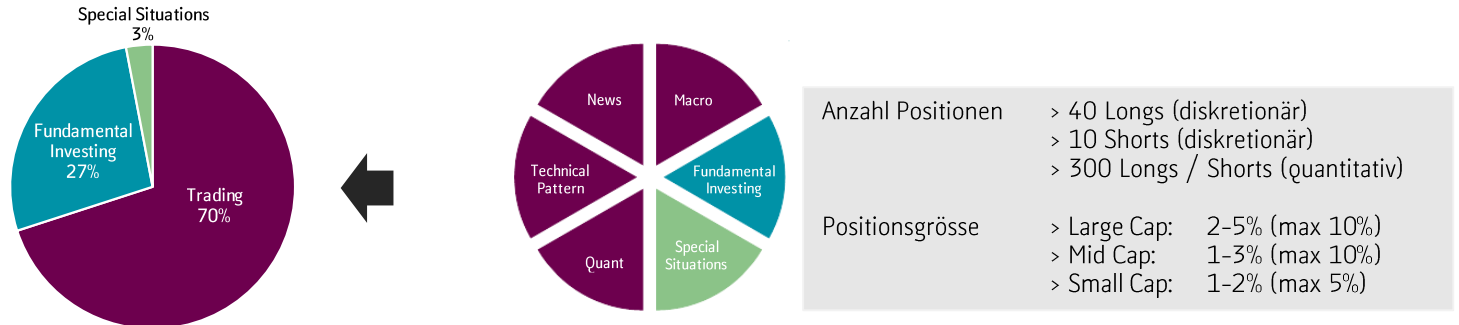
Limmat Capital

Limmat Capital ist eine Fondsboutique spezialisiert auf Trading orientierte Long-/Short Aktien und Managed Futures-Strategien. Seit ihrer Gründung im 2005 entwickelte die Limmat Capital eine state-of-the-art alternative Investment Plattform, die einzigartige Anlagelösungen für institutionelle Investoren, Family Offices, Vermögensverwalter und Privat Banker anbietet.

Mit einem Fokus auf das Risikomanagement ist es Limmat Capital seit 2005 gelungen, in verschiedenen Marktphasen, inklusive der Finanzkrise 2007–2008 und der Europakrise 2011–2012, konstante Renditen zu erzielen. Die Investoren in Limmat Capital Fonds konnten vom breiten Marktwissen wie auch der Vielfalt der Strategien, welche untereinander, aber auch im Vergleich zu anderen Anlagen tiefe Korrelationen aufweisen, profitieren.

Fondsstrategie

Opportunistisches Trading mit Fokus auf liquide europäische Aktien und Futures. Renditen, die durch realisierte Gewinne erzielt werden (über 25,000+ kleine Trades pro Jahr, viele kleine taktische Einzeltrades und einige grössere Teamentscheidungen).



LC Equity Strategy

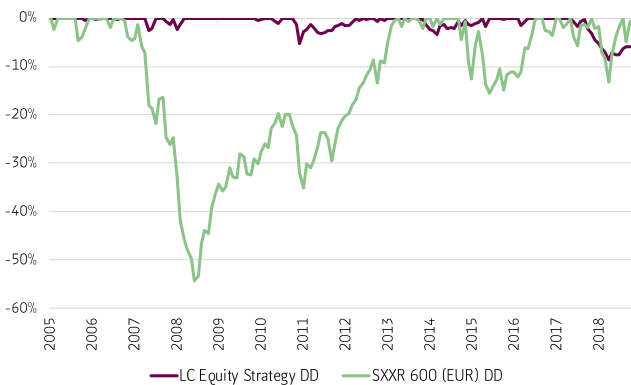
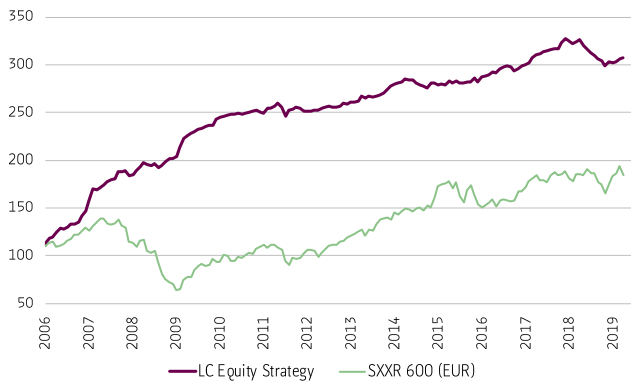
Rendite seit Auflegung 207.9%
Ann. Rendite 8.5%
Ann. Volatilität 5.4%
Max. Verlust -8.5%
Lifetime Sharpe ratio³ 1.51

Im November 2017 wurde Limmat Capital für ihre risiko-adjustierte Performance im LC Equity Fund mit dem ersten Preis der renommierten EuroHedge Emerging Fund Management Awards ausgezeichnet.

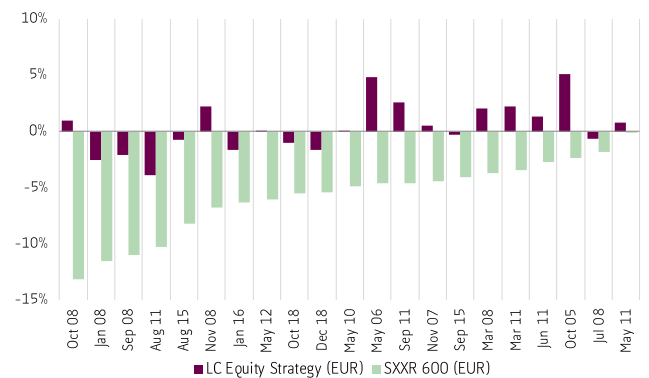
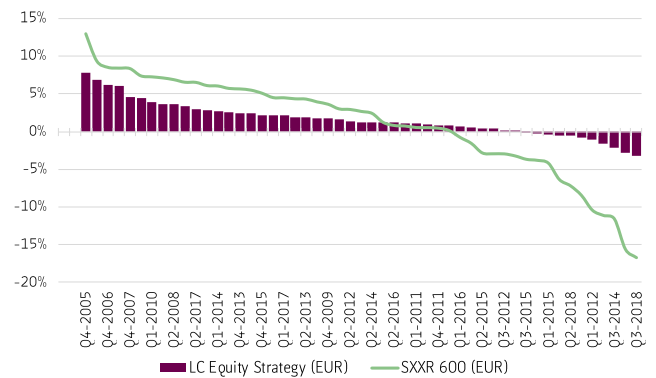
EuroHedge
Emerging Fund
Management Awards 2017
Winner

Performance²

Die Strategie mit überzeugendem Risikomanagement, zeigt insbesondere in einem unsicheren und volatilen Marktumfeld eine solide Downside-Protection.



Seit Lancierung hat die LC Equity Strategy in 78% der Quartale eine positive Rendite erzielt und nur 6 Quartale zeigten Verluste von -1% oder mehr.



	2005	2006	2007	2008	2009	2010	2011	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019*	ITD
LC Equity Strategy	7.9%	31.0%	33.9%	6.4%	17.8%	6.4%	0.8%	2.1%	5.3%	2.7%	2.1%	3.4%	9.2%	-7.4%	2.9%	207.9%
SXXR 600 (EUR)	4.5%	20.8%	2.4%	-43.8%	32.4%	11.6%	-8.6%	18.2%	20.8%	7.2%	9.6%	1.7%	10.6%	-10.8%	16.5%	92.5%

* Per 30.06.2019

Wichtige Fakten zum Fonds

LC Equity Fund - UCITS

Häufigkeit Handel Tägliches Handel

Mgmt/Perf Fee 1.50%/15.00%

Lancierungsdatum 1. März 2018

High Watermark kumulierend

Währungsklassen	ISIN	Valor	Bloomberg
B CHF	LU1749419476	39850790	LCSEQBC LX
B EUR	LU1749419559	39850793	LCSEQBE LX
B USD	LU1749419633	39850796	LCSEQBU LX

- 1 Die Strategie AuM beziehen sich auf das von der Limmat Capital Alternative Investments AG verwaltete Gesamtkapital in Onshore- und Offshore-Fonds, die dieselbe Strategie verfolgen, vorbehaltlich von Unterschieden, die sich aus regulatorischen Anforderungen ergeben. Die Firmen AuM beziehen sich auf das von der LIMMAT CAPITAL Alternative Investments AG über ihre Produkte verwaltete Gesamtkapital, jedoch ohne Kapitalflüsse am ersten Tag des Folgemonats. Alle AuM-Zahlen werden in Millionen US-Dollar (USD) ausgedrückt, und das in Anteilklassen investierte Kapital, deren Währung nicht USD ist, wird zum entsprechenden Wechselkurs umgerechnet, der am letzten Arbeitstag des Monats um 16.00 Uhr GMT gilt. Die Daten der AuM sind ungeprüft und nur für indikative Zwecke.
- 2 Die Fondsperspektive- und Drawdownzahlen wie auch die Fondsstatistiken widerspiegeln und beinhalten die geprüfte historische Performance des LC Trading Fund, eines in Liechtenstein ansässigen Vorgängers der LC Equity Fund Ltd. im Zeitraum von Oktober 2005 bis Juli 2008. Der LC Equity Fund verfolgt ähnliche Anlageziele und -strategien wie der LC Trading Fund und ist zu den gleichen Anlagekonditionen erhältlich (einschliesslich Zeichnungs-/Rücknahmebedingungen sowie Verwaltungs- und Performancegebühren). Die Aktienklassen in EUR und USD wurden am 1. August 2009 bzw. 1. Februar 2010 lanciert.
- 3 Lifetime Sharpe Ratio berechnet als annualisierte Rendite dividiert durch annualisierte Volatilität (ohne Berücksichtigung des risikofreien Zinssatzes). Quellen: Quintillion Limited, Bloomberg, Limmat Capital, LLB. Es kann nicht garantiert werden, dass die Ergebnisse der vergangenen Investitionen des Fonds auch in Zukunft erreicht werden. Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung. Eine Investition in den Fonds birgt erhebliche Risiken, einschliesslich des Verlusts der gesamten Investition. Renditen werden nach Abzug von Kosten, Performance Fees (15% p.a., jährlich abgegrenzt) und Management Fees (1,5% p.a., monatlich abgegrenzt) berechnet. Die angezeigten Renditen beinhalten Erträge aus Reinvestitionen. Werden solche Reinvestitionen nicht berücksichtigt, würde die Rendite niedriger ausfallen. Der Vergleich mit dem Stoxx600 Total Return Index dient nur der Veranschaulichung und soll nicht implizieren, dass die Erträge oder die Volatilität des Fonds ähnlich sein wird wie beim Index. Der Fonds wird mit diesem Index verglichen, da er häufig in Performance-Benchmarks verwendet wird. Der Index besteht aus Wertpapieren, welche sich grösstenteils von den Positionen, die der Fonds direkt halten würde unterscheiden und nicht das gleiche oder ein ähnliches Risiko/Rendite- oder Volatilitätsprofil wie der Fonds aufweisen.

Die folgenden Hinweise enthalten wichtige Informationen, die im Zusammenhang mit den in der beigefügten Präsentation dargestellten Informationen gelesen werden sollten. Der 'Fonds' bezeichnet den von der Limmat Capital Alternative Investments AG im Rahmen eines Investmentmanagementvertrages mit der MainFirst Affiliated Fund Managers S.A. verwalteten Privatfonds. Die dargestellten Renditen verstehen sich abzüglich aller Gebühren und Aufwendungen und der Reinvestition aller Ausschüttungen. Die Rendite eines bestimmten Anlegers kann von den beschriebenen Renditen abweichen, abhängig vom Zeitpunkt von Ein- und Auszahlungen sowie fremder Gebühren, welche für eine Investition zu entrichten sind.

Dieses Dokument wurde Ihnen auf Ihre ausdrückliche vorherige Anfrage hin und nur zu Informationszwecken zur Verfügung gestellt. Nichts in dieser Mitteilung darf so ausgelegt werden, dass es ein Angebot zum Verkauf oder eine Aufforderung zum Kauf einer Beteiligung am LC Equity Fund (UCITS) (der 'Fonds') durch jemanden in einer Gerichtsbarkeit darstellt, in der ein solches Angebot oder eine solche Aufforderung nicht zulässig ist, oder an eine Person, der gegenüber es rechtswidrig ist, ein solches Angebot oder eine solche Aufforderung abzugeben. Ein Angebot kann nur in Ländern gemacht werden, in denen ein Angebot rechtmässig ist, und nur auf der Grundlage des Verkaufsprospekts des Fonds.

Die Anteile des Fonds wurden und werden nicht gemäss dem U.S. Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung (der '1933 Act') registriert oder qualifiziert, und Anteile dürfen in den Vereinigten Staaten von Amerika (einschliesslich ihrer Territorien und Besitztümer) oder an oder zugunsten einer US-Person (wie im folgenden Satz definiert) oder direkt oder indirekt, mit Ausnahme der Registrierung oder einer Ausnahme, angeboten, verkauft oder übertragen werden. In diesem Zusammenhang ist eine 'US. Person' eine Person, die sich in einer der beiden folgenden Kategorien befindet: (a) eine Person, die in die Definition von 'US-Person' gemäss Regel 902 der Regulation S gemäss dem Gesetz von 1933 einbezogen ist, oder (b) eine Person, die von der Definition von 'Nicht-Vereinigte Staaten' gemäss CFTC-Regel 4.7 ausgeschlossen ist. Der Fonds wurde und wird nicht als Investmentgesellschaft nach dem U.S. Investment Company Act von 1940 in der jeweils gültigen Fassung (der '1940 Act') registriert. Anteile unterliegen Beschränkungen der Übertragbarkeit und des Weiterverkaufs und dürfen in den Vereinigten Staaten oder an eine US-Person nicht übertragen oder weiterverkauft werden, es sei denn, dies ist gemäss dem Gesetz von 1933 und den anwendbaren Wertpapiergesetzen des Bundesstaates zulässig, gemäss der Registrierung oder Befreiung davon.

Der Fonds ist ein alternativer Investmentfonds ('AIF') im Sinne der Richtlinie der Europäischen Union über die Verwaltung von alternativen Investmentfonds (Richtlinie 2011/61/EU) ('AIFMD'). Die Limmat Capital Alternative Investment AG ist der Manager für alternative Investmentfonds ('AIFM') des Fonds. Anteile dürfen nur an potenzielle Anleger oder diskretionäre Vermögensverwalter mit Wohnsitz oder Sitz in einem Mitgliedstaat des EWR ('EWR-Personen'), in dem das Inverkehrbringen gemäss der einschlägigen nationalen Umsetzung von Artikel 42 AIFMD registriert oder genehmigt wurde (falls zutreffend), und in solchen Fällen nur an EWR-Personen, die professionelle Anleger oder eine andere Personengruppe sind, für die dieses Inverkehrbringen nach den nationalen Gesetzen dieses Mitgliedstaats zulässig ist, vertrieben werden. Dieses Dokument ist nicht für andere EWR-Personen bestimmt, sollte nicht von ihnen herangezogen werden und sollte nicht als Angebot (oder eine andere Form des Marketings) an diese Personen ausgelegt werden. Ein 'Professioneller Anleger' ist ein Anleger, der als professioneller Kunde gilt oder der auf Anfrage im Rahmen der jeweiligen nationalen Umsetzung von Anhang II der Richtlinie 2004/39/EG

(Richtlinie über Märkte für Finanzinstrumente) und AIFMD als professioneller Kunde behandelt werden kann. Eine Liste der Rechtsordnungen, in denen der AIFM gemäss Artikel 42 AIFMD registriert oder (falls zutreffend) zugelassen wurde, ist auf Anfrage bei der Verwaltungsgesellschaft oder dem AIFM erhältlich.

Das Emissionsprotokoll und/oder andere Angebotsunterlagen im Zusammenhang mit den Anteilen des Fonds dürfen in der Schweiz ausschliesslich von der Schweizer Vertretung und/oder den zugelassenen Vertriebspartnern an qualifizierte Anleger zur Verfügung gestellt werden. Schweizer Vertreter des Fonds ist die Credit Suisse Funds AG, Uetlibergstrasse 231, 8045 Zürich, und die Schweizer Zahlstelle ist die Credit Suisse (Schweiz) AG, Paradeplatz 8, 8001 Zürich, Schweiz. Für die in der Schweiz oder aus der Schweiz vertriebenen Anteile ist der Gerichtsstand nach schweizerischem Recht der Sitz der Schweizer Vertretung. Kopien des Prospekts, der Statuten, des Key Investor Information Document (KIID) sowie der Geschäfts- und Halbjahresberichte sind kostenlos am Sitz der Schweizer Vertretung erhältlich. Veröffentlichungen werden auch unter www.mainfirst-fundmanagers.com publiziert.

Alle in diesem Dokument enthaltenen Informationen dürfen ohne vorherige schriftliche Zustimmung der Limmat Capital Alternative Investments AG weder ganz noch teilweise reproduziert oder anderweitig verbreitet werden. Für fehlerhaft gemeldete oder unvollständige Informationen übernehmen wir keine Haftung. Die hierin enthaltenen Informationen sind in ihrer Gesamtheit durch Bezugnahme auf alle Informationen im Emissionsprospekt des Fonds qualifiziert und ersetzen diese nicht, einschliesslich, aber nicht beschränkt auf die Risikofaktoren einer Anlage in den Fonds. Darüber hinaus werden die Informationen in diesem Dokument ab dem letzten Tag des auf dem Umschlag angegebenen Monats dargestellt, und jede Seite dieses Dokuments (sofern nicht anders angegeben) kann ohne Vorankündigung geändert werden und kann sich (möglicherweise wesentlich) zwischen dem Ende des Monats, ab dem diese Informationen vorgelegt werden, und dem Datum des Eingangs und/oder der Überprüfung dieses Dokuments geändert haben.

Die Zahlen, Tabellen, Diagramme und Werte in diesem Dokument werden ausschliesslich zu Ihrer Information erstellt und enthalten abgeleitete Informationen, die wir für richtig halten; die Informationen werden jedoch nicht unbedingt im Zusammenhang mit unserer Geschäftstätigkeit oder der Erstellung des Jahresabschlusses des Fonds verwendet. Die Informationen in diesen Berichten werden nicht von Dritten überprüft oder getestet, und wir können nicht garantieren, dass sie fehlerfrei sind. Jeder der beigefügten Berichte entspricht jeweils dem angegebenen Datum, und wir haben uns nicht verpflichtet, die Angaben darin zu aktualisieren. Wir können die Produktion dieses Dokuments jederzeit und ohne Vorankündigung einstellen.

Unsere Investitionsprogramme bergen erhebliche Risiken, einschliesslich des möglichen Verlusts des investierten Kapitals, und es kann nicht garantiert werden, dass die Anlageziele erreicht werden. Der Prospekt des Fonds enthält wichtige Informationen über Risikofaktoren, Interessenkonflikte und andere wesentliche Aspekte des Fonds und sollte vor einer Investitionsentscheidung sorgfältig gelesen werden. Die hierin enthaltenen Informationen können auf Schätzungen beruhen und dürfen in keinem Fall als zuverlässig angesehen werden. Die vergangene Performance sollte nicht als Indikator für die zukünftige Performance angesehen werden. Die Anlageziele und -strategien des Fonds können im Laufe der Zeit variiert haben und in Zukunft wesentlich von denen abweichen, die für die Generierung der in diesem Dokument beschriebenen Ergebnisse verwendet werden.