

# Fortem Absolute Return Fund



## ANLAGESTRATEGIE

Stabile Renditen. Kontrolliertes Risiko. Ein echter Alternativer-Baustein.  
Der Fonds Fortem Capital Absolute Return Fund zielt auf Cash + 2–4 % p.a. ab – unabhängig davon, wohin sich die Aktienmärkte bewegen. Durch eine globale Long-Position, optimiert über Faktorstrategien, und eine Short-Komponente von rund 70 % entsteht ein nahezu marktneutrales Profil mit niedrigem, stabilem Beta.  
Als täglich handelbarer UCITS-Fonds bietet er Anlegern eine Alternative, die nicht der klassischen Bewegung der Aktien- oder Anleihemärkte folgt, sondern auf aktive Long/Short-Steuerung setzt.  
Das Ergebnis: robuste, risikokontrollierte Wachstumschancen selbst in herausfordernden Marktphasen.  
Die Strategie existiert im UCITS-Mantel seit 10-2023. Das aktuelle Volumen beträgt 378 Mio. EUR.  
Fortem Capital mit Sitz in London verwaltet aktuell 2,6 Mrd. USD in Liquid Alternatives Strategien.

## WERTENTWICKLUNG (per 03.05.2024)



## Performance

|           | lfd. Monat | lfd. Jahr | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre |
|-----------|------------|-----------|--------|---------|---------|----------|
| Portfolio | 3,31%      | 14,78%    | 20,51% | -       | -       | -        |

## Marktkommentar

UCITS Hedge Award 2026 Gewinner – Absolute Return neu definiert.  
Mit seinem marktneutralen Long/Short-Ansatz und dem Fokus auf stabile Cash-plus-Erträge wurde der Fortem Capital Absolute Return Fund im März 2026 in London ausgezeichnet. Die Strategie adressiert genau das, was viele Portfolios heute suchen: Liquidität, Transparenz, kontrollierte Volatilität und attraktive Renditechancen jenseits traditioneller Aktien- und Anleihemärkte.  
Fondsentwicklung  
  
Der Absolute Return Fund erzielte im 1.HJ 2026 eine Rendite von 14,78%.  
Die Strategie basiert auf einem klar strukturierten Ansatz:  
Erwartete Rendite = Income + Beta + Diversifier  
  
Income: Erträge aus dem Collateral- und Funding-Portfolio  
Beta: Strukturelle Aktienmarkt-Exponierung von rund 30% netto long  
Diversifier: USD-Exposure sowie Faktorprämien (Value, Momentum, Quality, Size)  
  
Zentraler Performance-Treiber war im Quartal das Equity Long/Short-Segment. Dieses wird systematisch als faktorbasierte Long-Position gegen eine Short-Position im breiten Aktienmarkt umgesetzt. Das Long-Portfolio erzielte eine Rendite von +1,1%, während der globale Aktienmarkt (MSCI World) um -3,6% nachgab – ein klarer Beleg für die Effektivität der Faktorallokation in einem rückläufigen Marktumfeld.

## FONDSDETAILS

|                       |                                                                    |
|-----------------------|--------------------------------------------------------------------|
| Name                  | Fortem Capital Absolute Return Fund - F EUR ACC                    |
| ISIN                  | IE000YDM2U69                                                       |
| WKN                   | A41805                                                             |
| Fondspreis            | 1,264€ (30.06.26)                                                  |
| Fondsvermögen         | 324.191.650 €                                                      |
| Fondsdomizil          | IRL                                                                |
| SFDR Kategorie        | -                                                                  |
| Anteilsklasse         | F (EUR Hedged)                                                     |
| Fondskategorie        | Absolute Return                                                    |
| Auflagedatum          | 3.5.2024                                                           |
| Anteilsklassenwährung | EUR                                                                |
| KVG                   | IQ EQ Fund Management (Ireland) Limited                            |
| Verwahrstelle         | Northern Trust Fiduciary Services (Ireland) Limited, Dublin Branch |
| Beraterhonorar        | 0,00%                                                              |
| Produktkosten         | 0,85%                                                              |
| Ausgabeaufschlag      | 2,00%                                                              |
| MSTR ESG Rating       |                                                                    |

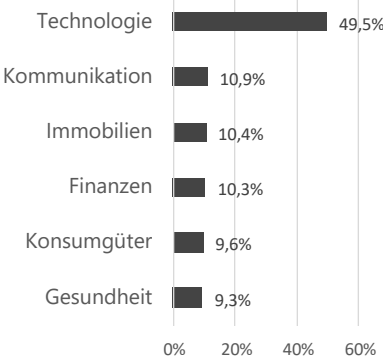
## FONDSMANAGER

IQ EQ Fund Management (Ireland) Limited  
IQ EQ Fund Management (Ireland) Limited

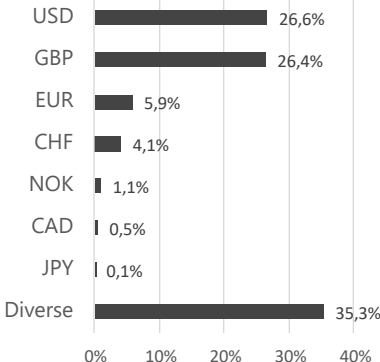
# Fortem Absolute Return Fund

## ALLOKATIONEN

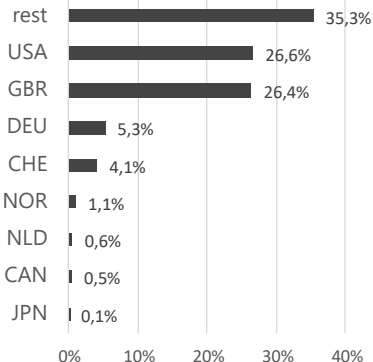
### BRANCHEN



### WÄHRUNGEN



### REGIONEN



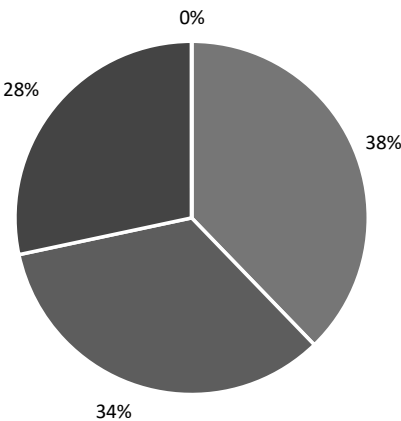
## STATISTIK

|                     | lfd. Jahr | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Auflage |
|---------------------|-----------|--------|---------|---------|----------|---------|
| Rendite             | 14,78%    | 20,51% | -       | -       | -        | 26,44%  |
| Volatilität p.a.    | 7,97%     | 6,19%  | -       | -       | -        | 4,43%   |
| Downside Volatility | 4,25%     | 3,36%  | -       | -       | -        | 3,19%   |
| Max. Drawdown       | -3,00%    | -3,00% | -       | -       | -        | -4,31%  |
| Sharpe Ratio        | -         | 3,31   | -       | -       | -        | 2,59    |
| Sortino Ratio       | -         | 6,11   | -       | -       | -        | 3,60    |
| Calmar Ratio        | -4,93     | -6,85  | -       | -       | -        | -2,67   |

## TOP 10 HOLDINGS

| ISIN         | Name                                                 | Anteil |
|--------------|------------------------------------------------------|--------|
| GB00BSGLCK60 | United Kingdom of Great Britain and Northern Ireland | 5,66%  |
| GB00BSGLR014 | United Kingdom of Great Britain and Northern Ireland | 5,14%  |
| GB00BSGLBC12 | United Kingdom of Great Britain and Northern Ireland | 4,83%  |
| GB00BSGM6411 | United Kingdom of Great Britain and Northern Ireland | 4,78%  |
| GB00BSGLNF80 | United Kingdom of Great Britain and Northern Ireland | 4,65%  |
| GB00BSGHVY18 | United Kingdom of Great Britain and Northern Ireland | 4,03%  |
| GB00BSGJ6B99 | United Kingdom of Great Britain and Northern Ireland | 3,68%  |
| CA1350Z7DN17 | Canada (Government of)                               | 3,33%  |
| GB00BSGM4P81 | United Kingdom of Great Britain and Northern Ireland | 3,30%  |
| GB00BSGM0F04 | United Kingdom of Great Britain and Northern Ireland | 2,98%  |

## ANLAGESTRATEGIE



■ Anleihen ■ Cash ■ Aktien ■ Sonstige

Fortem Absolute Return Fund



MONATLICHE/JÄHRLICHE RENDITEN

|      | Jan   | Feb    | Mrz    | Apr   | Mai    | Jun   | Jul   | Aug   | Sep    | Okt    | Nov   | Dez    | YTD    |
|------|-------|--------|--------|-------|--------|-------|-------|-------|--------|--------|-------|--------|--------|
| 2024 |       |        |        |       | -0,05% | 0,22% | 1,12% | 0,16% | -0,37% | 0,91%  | 2,37% | -2,05% | 2,27%  |
| 2025 | 1,96% | -0,24% | -1,56% | 0,26% | 1,32%  | 0,86% | 1,56% | 1,09% | 0,77%  | -0,59% | 1,13% | 0,94%  | 7,71%  |
| 2026 | 3,49% | 3,33%  | -2,30% | 3,27% | 2,98%  | 3,31% |       |       |        |        |       |        | 14,78% |

## RECHTLICHE HINWEISE

---

Ansprechpartner in Deutschland  
Active Fund Placement GmbH  
Schäfergasse 52 | 60313 Frankfurt am Main  
Telefon: +49 69 34 872 77 94 | Mobil: +49 1511 2288764  
ms@fundplacement.de | www.fundplacement.de

Amtsgericht Frankfurt am Main | HRB 87594  
Geschäftsführer: Andreas Kümmert, Stephan Jacobs

Rechtliche Hinweise gem. §16 Abs. 2 und §17 FinVermV

Bitte beachten Sie, dass eine Beurteilung der Angemessenheit der Finanzanlagen im Sinne des § 16 Abs. 2 FinVermV mangels der erforderlichen Informationen nicht möglich ist. Die Active Fund Placement GmbH erhält laufende Zuwendungen von Dritten (Produktgebern), die anteilig aus den jährlichen Verwaltungsvergütungen und Performance Fees der jeweiligen Fonds entnommen werden und bei der Active Fund Placement GmbH verbleiben. Die exakte Höhe der vereinnahmten Zuwendungen wird auf Wunsch jedem Investor offengelegt.

Bei diesem Dokument handelt es sich um Marketingmaterial. Diese Unterlage dient ausschließlich Informationszwecken und stellt weder eine Anlageberatung noch eine Anlagevermittlung, eine individuelle Empfehlung noch ein Angebot oder eine Aufforderung zum Kauf oder Verkauf von Finanzinstrumenten dar. Sie ersetzt keine anleger- und anlagegerechte Beratung. Die enthaltenen Informationen wurden mit größtmöglicher Sorgfalt zusammengestellt. Gleichwohl übernehmen weder der Herausgeber noch verbundene Unternehmen eine Haftung für die Richtigkeit, Vollständigkeit oder Aktualität der bereitgestellten Daten. Maßgeblich sind ausschließlich die jeweiligen offiziellen Verkaufs- und Emissionsunterlagen sowie die individuellen Vertragsbedingungen des jeweiligen Finanzinstruments.

### 1. Bewertungsgrundlagen / Kursquellen

Sofern nicht anders angegeben, basieren die dargestellten Bewertungen auf folgenden Grundlagen:

- Investmentfonds: Bewertung auf Basis der zuletzt verfügbaren Nettoinventarwerte (NAV) der jeweiligen Kapitalverwaltungsgesellschaft. Ausschüttungen werden – sofern nicht anders angegeben – rechnerisch wiederangelegt.
- Aktien, Anleihen, ETFs und Zertifikate: Bewertung zu den Börsenschlusskursen des letzten verfügbaren Handelstages an der jeweils maßgeblichen Referenzbörse.
- Nicht börsengehandelte Instrumente: Bewertung auf Basis verfügbarer Markt- bzw. indikativ gestellter Preise externer Datenprovider.

- Individuelle Kosten, Gebühren und Steuern können die tatsächliche Wertentwicklung mindern.

Abweichungen zwischen verschiedenen Datenquellen sind aufgrund unterschiedlicher Bewertungsmethoden oder Zeitpunkte möglich.

### 2. Wertentwicklungen

Die dargestellte Wertentwicklung der Vergangenheit ist kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Entwicklung. Der Wert einer Kapitalanlage sowie die daraus erzielten Erträge können steigen oder fallen. Ein vollständiger Verlust des eingesetzten Kapitals kann nicht ausgeschlossen werden.

### 3. Währungsrisiken

Sofern Anlagen in Fremdwährungen erfolgen, können Wechselkursschwankungen die Wertentwicklung zusätzlich positiv oder negativ beeinflussen.

### 4. Steuerliche Hinweise

Die steuerliche Behandlung hängt von den persönlichen Verhältnissen des jeweiligen Anlegers ab und kann zukünftigen Änderungen unterliegen. Eine steuerliche Beratung wird nicht erbracht.

### 5. Datenquellen

Die in dieser Unterlage enthaltenen Daten stammen teilweise von externen Informations- und Datenanbietern. Für deren Richtigkeit, Vollständigkeit und Aktualität wird keine Haftung übernommen.

### 6. Verbindlichkeit von Informationen

Rechtsverbindlich sind ausschließlich die jeweiligen Vertragsunterlagen, Verkaufsprospekte, Emissionsbedingungen sowie die gesetzlichen Pflichtdokumente der jeweiligen Finanzinstrumente.