

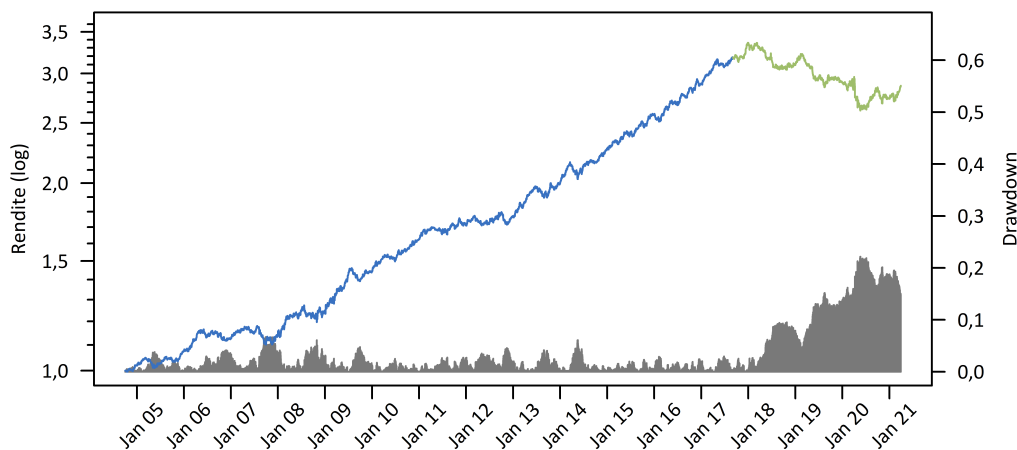


# AC Equity Europe Long Short

Multi-Faktor Investment in "Hidden Champions"

März 2021

## Rendite / Drawdown



Überschufrenditen gegenüber Geldmarkt, inkl. Transaktionskosten, Management Fee nicht enthalten, Daten bis 31. März 2021

## Strategieinformationen

Index Sponsor Alpha Centauri  
Investment Management GmbH

Indexberechnung Lixx GmbH  
Indexadministration Lixx GmbH  
Auflagedatum 04.09.2017  
Startwert 100

## Identifizier

Bloomberg ALCEEEP <Index>  
RIC .ALCEEEP  
ISIN DE000SLA33B3  
WKN SLA33B

## Produkte

Zertifikate/Swap versch. Banken  
(Details auf Anfrage)

## Return und Risiko

	1 Monat	3 Monate	6 Monate	9 Monate	1 Jahr	2 Jahre	3 Jahre	seit Start
Rendite	4,04%	5,04%	1,46%	8,78%	-1,64%	-7,87%	-13,00%	186,91%
Aktien*	6,42%	8,20%	19,90%	20,67%	36,95%	18,99%	25,21%	180,37%
Rendite p.a.	—	—	—	—	-1,64%	-4,01%	-4,53%	6,59%
Aktien*	—	—	—	—	36,95%	9,07%	7,77%	6,44%
Volatilität	5,17%	5,35%	5,88%	5,84%	7,62%	6,93%	6,40%	4,96%
Aktien*	9,84%	9,93%	12,11%	12,84%	15,77%	17,69%	15,55%	15,58%
Max Drawdown	-1,01%	-2,90%	-5,80%	-5,80%	-11,72%	-15,98%	-20,86%	-22,17%
Aktien*	-1,04%	-3,90%	-8,34%	-8,94%	-8,94%	-35,36%	-35,36%	-58,69%

\* STOXX Europe 600

\* zu Aktien/STOXX Europe 600

## Strategie Kennzahlen

Rendite	186,91%
Rendite p.a.	6,59%
Volatilität	4,96%
Sharpe Ratio	1,33
Korrelation*	-0,09
Beta*	-0,03
Max Drawdown	-22,17%
Längster Drawdown	289 Tage
Value at Risk 99%	-0,84%

## Monatliche Rendite

Jahr	Jan	Feb	Mrz	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez
2004										0,60%	-0,66%	1,94%
2005	1,31%	1,29%	-0,58%	-1,62%	-0,25%	0,87%	1,39%	0,15%	-0,40%	0,21%	0,85%	2,30%
2006	-0,18%	2,34%	1,85%	2,95%	0,17%	-1,51%	1,23%	0,19%	-0,63%	-2,30%	0,06%	0,65%
2007	1,44%	0,92%	0,58%	1,12%	-1,89%	-0,36%	2,44%	-3,54%	-2,86%	2,51%	-0,17%	0,79%
2008	2,66%	3,60%	0,79%	0,65%	-0,16%	2,26%	-1,14%	-0,51%	0,03%	-1,78%	2,79%	0,54%
2009	2,16%	1,02%	3,15%	2,77%	-0,19%	4,52%	1,60%	-2,70%	-1,28%	2,15%	1,03%	0,46%
2010	3,17%	0,13%	2,11%	0,92%	-0,66%	-1,37%	2,83%	0,27%	0,90%	1,60%	0,92%	1,29%
2011	2,66%	-0,34%	1,76%	0,15%	-0,73%	-0,98%	0,84%	1,30%	0,63%	0,26%	-0,04%	-0,37%
2012	1,89%	1,42%	-1,19%	-1,76%	0,94%	-0,40%	0,20%	2,19%	1,55%	-3,70%	0,52%	1,99%
2013	1,56%	2,92%	0,77%	2,73%	1,29%	1,38%	-1,00%	-2,51%	0,79%	3,10%	0,14%	1,09%
2014	2,85%	3,65%	0,45%	-2,99%	0,21%	2,52%	1,31%	0,54%	-0,48%	2,00%	0,27%	2,86%
2015	1,10%	1,11%	-0,08%	1,46%	2,47%	-0,03%	-0,36%	1,96%	1,94%	-0,94%	3,07%	0,93%
2016	-1,70%	1,43%	3,24%	1,22%	0,53%	-0,51%	2,93%	-0,70%	3,46%	-0,39%	3,89%	-1,64%
2017	2,31%	1,03%	2,47%	2,94%	-1,37%	-0,59%	1,77%	1,43%	0,51%	-0,16%	0,24%	4,78%
2018	-1,95%	1,14%	-1,05%	-1,34%	-2,61%	0,41%	-3,30%	-0,76%	0,27%	0,20%	0,77%	0,14%
2019	2,75%	0,65%	-2,73%	-1,44%	-4,01%	-0,29%	0,01%	-1,09%	1,18%	-0,09%	0,63%	-1,76%
2020	-1,23%	1,71%	-0,01%	-7,76%	-0,94%	-1,05%	3,05%	1,58%	2,43%	-3,24%	0,53%	-0,70%
2021	1,74%	-0,78%	4,04%									

## Jährliche Rendite

Jahr	Rendite
2004	1,87%
2005	5,61%
2006	4,78%
2007	0,76%
2008	9,99%
2009	15,49%
2010	12,68%
2011	5,20%
2012	3,53%
2013	12,81%
2014	13,82%
2015	13,30%
2016	12,17%
2017	16,28%
2018	-7,89%
2019	-6,19%
2020	-5,94%
2021	5,04%

Diese Unterlagen sind vertraulich. Jede Nutzung oder Weitergabe an Dritte ohne Zustimmung der Ersteller ist nicht gestattet. Diese Unterlagen dienen ausschließlich zu Ihrer Information und stellen weder ein Angebot noch eine Aufforderung zur Abgabe eines Angebotes zum Kauf oder Verkauf von bestimmten Produkten dar. Die Gültigkeit der Informationen und Empfehlungen ist auf den Zeitpunkt der Erstellung dieser Unterlagen beschränkt und kann sich je nach Marktsituation und Ihrer Zielsetzung ändern. Wir empfehlen Ihnen, vor einer Investition Ihren Steuer- oder Rechtsberater zu konsultieren. Die in diesen Unterlagen enthaltenen Informationen und Meinungen stammen aus Quellen, die wir als zuverlässig ansehen. Eine Gewähr für deren Richtigkeit können wir allerdings nicht übernehmen. Die Wertentwicklung einer Anlage in der Vergangenheit bietet keine Gewähr für die künftige Entwicklung. Zu beachten ist ferner, dass die hier vorgestellten Produkte unter Umständen in Hinblick auf die individuellen Anlageziele, die Portfolio- und Risikostruktur des jeweiligen Anlegers nicht angemessen sind. Die sich aus diesen Unterlagen eventuell ergebenden rechtlichen und steuerlichen Aspekte haben ausnahmslos den Charakter unverbindlicher Hinweise und können eine eingehende Beratung durch Ihren Rechtsanwalt, Steuerberater und/oder Wirtschaftsprüfer nicht ersetzen. Beachten Sie bitte, dass sich diese Unterlage nicht an Bürger der Vereinigten Staaten von Amerika richtet und in den Vereinigten Staaten von Amerika nicht verbreitet werden darf.