

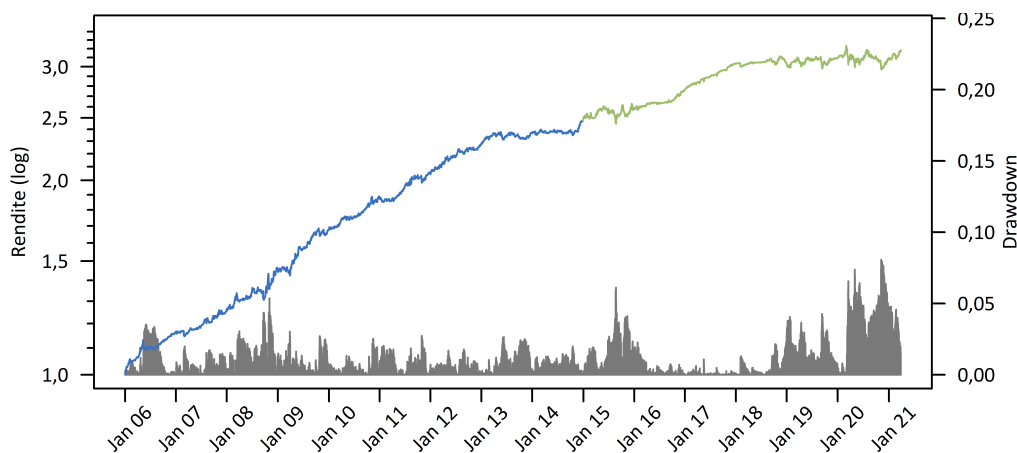


AC Alternative Beta

Liquide Alternative Risikoprämien

März 2021

Rendite / Drawdown



Management Fee nicht enthalten, Daten bis 31. März 2021

Strategieentwicklung

Alpha Centauri
Investment Management GmbH

Partner

Vontobel Europe AG

Mögliche Strukturen

Managed Zertifikat
UCITS Fonds
Spezialfonds

Return und Risiko

	1 Monat	3 Monate	6 Monate	9 Monate	1 Jahr	2 Jahre	3 Jahre	seit Start
Rendite	2,61%	3,31%	2,37%	2,98%	1,87%	3,70%	5,02%	218,36%
Aktien*	6,42%	7,87%	19,90%	20,67%	36,95%	18,99%	25,21%	111,79%
Rendite p.a.	—	—	—	—	1,87%	1,83%	1,64%	7,89%
Aktien*	—	—	—	—	36,95%	9,05%	7,76%	5,04%
Volatilität	4,04%	4,23%	5,26%	5,93%	6,29%	5,80%	5,11%	4,96%
Aktien*	11,27%	11,80%	14,43%	15,27%	18,80%	21,11%	18,56%	19,57%
Max Drawdown	-0,48%	-1,94%	-4,66%	-6,78%	-6,78%	-8,08%	-8,08%	-8,08%
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

Strategiekennzahlen

Rendite	218,36%
Rendite p.a.	7,89%
Volatilität	4,96%
Sharpe Ratio	1,59
Korrelation*	0
Beta*	0
Max Drawdown	-8,08%
Längster Drawdown	288 Tage
Value at Risk 99%	-0,96%

Monatliche Rendite

Jahr	Jan	Feb	Mrz	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez
2006	4,48%	0,52%	1,15%	3,29%	-0,32%	0,64%	-0,60%	1,86%	0,93%	0,98%	1,53%	0,74%
2007	-0,14%	-0,86%	0,84%	1,20%	0,37%	0,77%	2,39%	-0,92%	2,38%	0,56%	0,06%	1,09%
2008	1,22%	2,87%	-0,34%	0,21%	0,38%	2,39%	-0,35%	1,23%	-2,60%	4,13%	1,83%	4,16%
2009	0,17%	0,15%	-2,12%	5,24%	3,81%	0,39%	1,34%	2,77%	1,65%	-1,09%	0,93%	1,15%
2010	0,86%	0,27%	2,47%	0,90%	-0,66%	0,62%	0,69%	1,58%	1,24%	1,66%	0,78%	1,51%
2011	-1,77%	0,63%	0,32%	0,57%	1,73%	1,98%	1,34%	1,59%	0,96%	-1,07%	1,33%	1,12%
2012	1,01%	1,00%	1,27%	1,76%	0,92%	-0,42%	1,95%	-0,61%	1,29%	0,62%	-0,19%	1,63%
2013	1,91%	0,28%	1,86%	-0,21%	-1,42%	0,68%	0,51%	-0,82%	-0,37%	-0,24%	0,74%	1,43%
2014	-0,40%	1,29%	-0,53%	-0,36%	0,38%	-0,28%	0,15%	-0,48%	0,78%	-0,35%	1,32%	2,77%
2015	2,56%	0,19%	-1,59%	2,96%	1,11%	-1,65%	0,38%	-1,97%	1,11%	-1,30%	1,07%	1,84%
2016	-0,76%	1,25%	0,74%	0,39%	0,24%	-0,13%	0,07%	0,07%	0,65%	1,22%	0,75%	1,95%
2017	1,35%	0,97%	0,44%	0,84%	0,72%	0,26%	0,75%	1,03%	0,64%	0,68%	1,02%	0,68%
2018	0,22%	-0,71%	0,49%	0,14%	0,29%	0,05%	0,24%	0,58%	-0,35%	0,17%	0,78%	-1,42%
2019	-1,03%	1,84%	0,00%	-0,87%	1,15%	-0,53%	1,51%	-0,38%	-1,19%	-0,53%	1,33%	0,21%
2020	0,95%	1,70%	-1,50%	-2,04%	1,06%	-0,08%	3,11%	-2,24%	-0,20%	-1,38%	-2,04%	2,56%
2021	0,59%	0,10%	2,61%									

Jährliche Rendite

Jahr	Rendite
2006	16,18%
2007	7,95%
2008	16,00%
2009	15,11%
2010	12,57%
2011	9,00%
2012	10,66%
2013	4,37%
2014	4,31%
2015	4,65%
2016	6,62%
2017	9,77%
2018	0,46%
2019	1,46%
2020	-0,29%
2021	3,31%

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.