

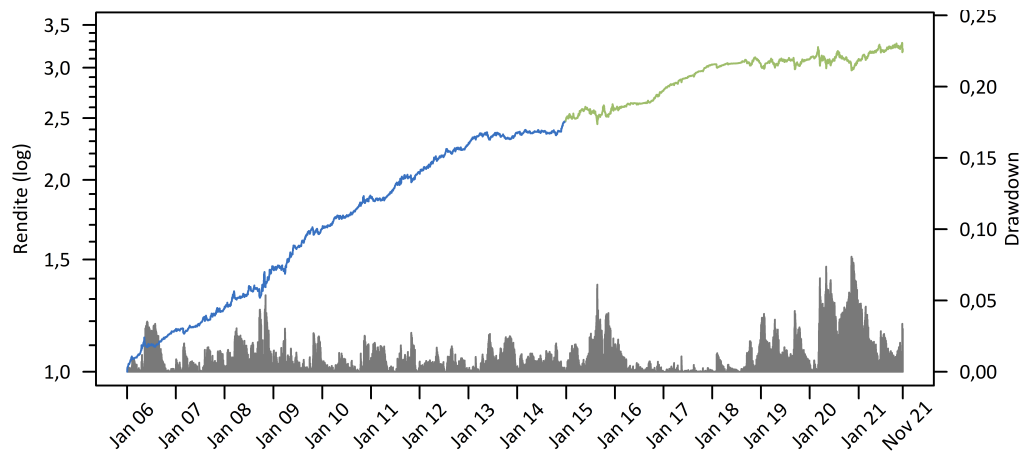


# AC Alternative Beta

## Liquide Alternative Risikoprämien

November 2021

### Rendite / Drawdown



Management Fee nicht enthalten, Daten bis 30. November 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	Strategiekennzahlen	
Rendite	-1,23%	-1,44%	-0,88%	2,62%	5,98%	3,25%	3,05%	218,40%	Rendite	218,40%
Aktien*	-2,53%	-1,33%	4,43%	16,54%	21,54%	18,60%	39,23%	131,92%	Rendite p.a.	7,55%
Rendite p.a.	—	—	—	—	5,98%	1,61%	1,01%	7,55%	Volatilität	5,04%
Aktien*	—	—	—	—	21,54%	8,88%	11,65%	5,43%	Sharpe Ratio	1,5
Volatilität	13,78%	9,18%	7,30%	6,35%	5,96%	6,35%	5,83%	5,04%	Korrelation*	0,01
Aktien*	14,61%	13,02%	11,88%	11,89%	11,88%	21,26%	18,74%	19,31%	Beta*	0
Max Drawdown	-3,36%	-3,36%	-3,36%	-3,36%	-3,36%	-8,08%	-8,08%	-8,08%	Max Drawdown	-8,08%
Aktien*	-5,45%	-5,45%	-5,45%	-5,45%	-5,45%	-35,36%	-35,36%	-58,69%	Längster Drawdown	318 Tage
									Value at Risk 99%	-0,97%

\* STOXX Europe 600

\* zu Aktien/STOXX Europe 600

### Monatliche Rendite

Jahr	Jan	Feb	Mrz	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	Jährliche Rendite
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%	16,18%
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%	7,95%
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%	16,00%
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%	15,11%
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%	12,57%
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%	9,00%
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%	10,66%
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%	4,37%
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%	4,31%
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%	4,65%
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%	6,62%
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%	9,77%
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%	0,46%
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%	1,46%
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%	-0,29%
2021	0,59%	0,10%	2,61%	-0,16%	1,07%	-0,61%	0,13%	1,05%	0,13%	-0,34%	-1,23%		3,33%

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.