

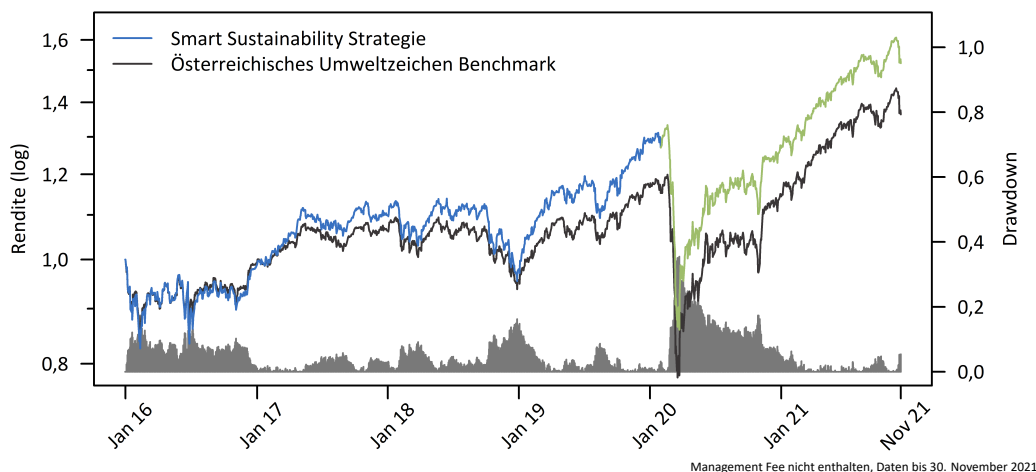


AC Smart Sustainability

Multi-Faktor Investment mit reduziertem CO₂-Fußabdruck

November 2021

Rendite / Drawdown



Strategieentwicklung

Alpha Centauri
Investment Management GmbH

Partner

CO₂-Daten ISS ESG

Konformität

Österreichisches Umweltzeichen

Mögliche Strukturen

Zertifikat
Swap
UCITS Fonds
kapitalgarantierte IHS

Return und Risiko

	1 Monat	3 Monate	6 Monate	9 Monate	1 Jahr	2 Jahre	3 Jahre	seit Start
Rendite	-2,67%	-0,82%	6,01%	17,98%	23,40%	20,90%	47,48%	52,24%
Aktien*	-2,37%	-1,19%	4,63%	17,02%	22,09%	18,79%	35,16%	36,41%
Rendite p.a.	—	—	—	—	23,40%	9,93%	13,81%	7,36%
Aktien*	—	—	—	—	22,09%	8,97%	10,55%	5,38%
Volatilität	13,99%	12,31%	11,22%	11,26%	11,32%	20,35%	18,10%	16,33%
Aktien*	14,66%	12,99%	11,85%	11,71%	11,70%	20,97%	18,17%	15,34%
Max Drawdown	-5,36%	-5,36%	-5,36%	-5,36%	-5,36%	-35,49%	-35,49%	-35,49%
Aktien*	-5,46%	-5,46%	-5,46%	-5,46%	-5,46%	-35,26%	-35,26%	-35,26%

Strategie Kennzahlen

Rendite	52,24%
Rendite p.a.	7,36%
Volatilität	16,33%
Sharpe Ratio	0,45
Korrelation*	0,98
Beta*	1,04
Max Drawdown	-35,49%
Längster Drawdown	273 Tage
Value at Risk 99%	-3,19%

* Österreichisches Umweltzeichen Benchmark

* zu Aktien/Österreichisches Umweltzeichen Benchmark

Monatliche Rendite

Jahr	Jan	Feb	Mrz	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez
2015												0,00%
2016	-7,36%	-2,09%	1,96%	0,88%	3,15%	-7,36%	4,92%	-0,34%	-0,01%	-0,51%	0,80%	5,32%
2017	0,36%	2,38%	4,55%	3,05%	0,55%	-2,72%	0,33%	-0,12%	3,54%	2,04%	-2,97%	0,39%
2018	1,66%	-4,07%	-2,02%	4,62%	0,23%	-0,47%	2,42%	-0,81%	0,06%	-5,96%	-1,52%	-5,10%
2019	7,44%	4,54%	2,87%	3,36%	-3,51%	3,61%	-0,81%	-2,20%	4,98%	1,95%	3,71%	2,05%
2020	-1,11%	-9,30%	-14,49%	8,19%	3,17%	2,68%	0,10%	3,64%	-0,24%	-5,69%	11,91%	2,93%
2021	-1,56%	3,24%	6,36%	1,54%	3,05%	1,94%	2,71%	2,08%	-3,08%	5,13%	-2,67%	

Jährliche Rendite

Jahr	Rendite
2015	0,00%
2016	-1,54%
2017	11,68%
2018	-10,91%
2019	31,18%
2020	-1,18%
2021	19,89%

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.



AC Smart Sustainability

Multi-Faktor Investment mit reduziertem CO₂-Fußabdruck

November 2021

Faktorprämien haben im Gegensatz zu Alpha einen positiven Erwartungswert

Strategiekonzept

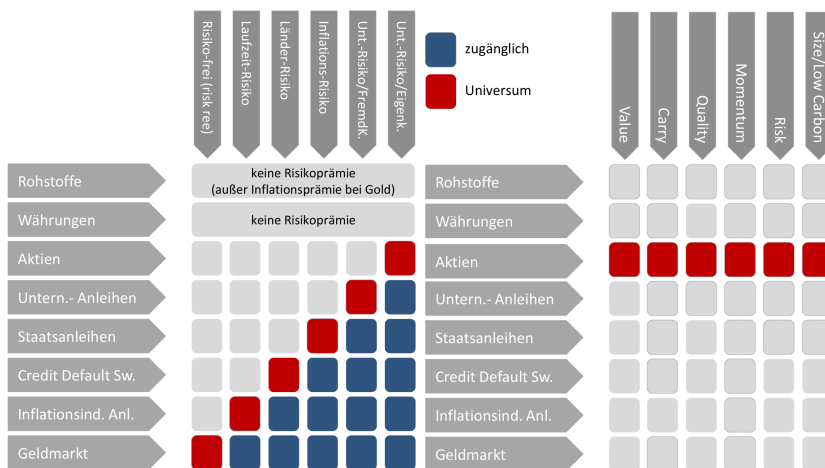
Faktorprämien entschädigen ökonomisch für die Übernahme von systematischen Risiken jenseits des Marktrisikos und sind für Aktien seit den Arbeiten von Fama/French (u. a. Market-, Value-, Size-Prämien), Carhart (Momentum-Prämie) und Roll/Ross (Arbitrage Pricing Theory) sowie in anderen Assetklassen empirisch gut belegt. Breitgefächerte Risikoprämien- oder Faktorkonzepte diversifizieren die individuellen Risiken der Prämien und gehen auf der Aktienseite u.a. auf die Arbeiten von Haugen/Baker zurück.

Faktorbasierte Aktienausswahl nach:

- niedrigen CO₂-Emissionen
- niedriger Bewertung
- stabilen Gewinnen
- realisierten Aktienrückkäufen
- positivem Momentum
- Unternehmensgröße
- hoher Handelsliquidität
- und weiteren Kriterien

Traditionelle Risikoprämien

Alternative Risiko-/Faktorprämien



Risiko kontrolliert:

- sektorneutral

Umsetzung:

- Kriterien des österreichischen Umweltzeichen erfüllt
- ca. 60 Einzelaktien
- OGAW- / UCITS-fähig
- 5/10/40-Regeln erfüllt

Prämien über Assetklassen hinweg

Prämien innerhalb von Assetklassen

Investieren in Zeiten des Klimawandels

Kontakt

Investments sind ein Kernelement des Pariser Klimaschutzabkommens mit dem Ziel, diese in Einklang mit niedrigen Treibhausgasemissionen und klimafreundlicher Entwicklung zu bringen. Das bedeutet für Investoren, dass sich Investments in Low-Carbon Assets auszahlen werden, da sich Investitionen von einer hohen zu einer niedrigen CO₂-Ökonomie verschieben.

Alpha Centauri

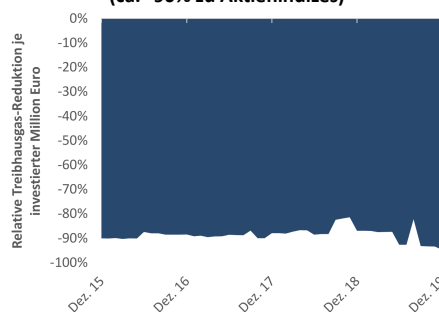
www.alpha-centauri.com

- Ulf Füllgraf
+49 (40) 89 7273-18
uf@alpha-centauri.com
- Benjamin Badel
+49 (40) 89 7273-21
bb@alpha-centauri.com

Alpha Centauri Veröffentlichungen zum Thema verfügbar



Reduzierter CO₂-Fußabdruck (ca. -90% zu Aktienindizes)



ISS ESG

www.issgovernance.com/esg-de/

- Maximilian Horster
maximilian.horster@iss-esg.com

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.