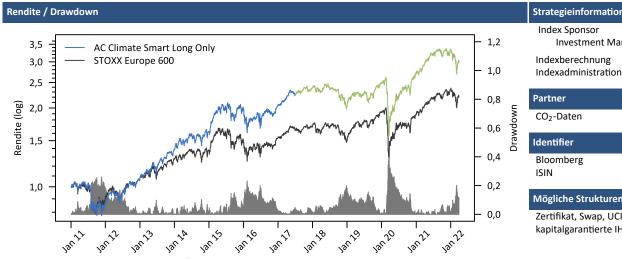


AC Climate Smart Long Only

Multi-Faktor Investment mit reduziertem CO₂-Fußabdruck

März 2022



Strategieinformation	en
Index Sponsor	Alpha Centauri
investment iviar	nagement GmbH
Indexberechnung	Lixx GmbH
Indexadministration	Lixx GmbH

Partner	
CO ₂ -Daten	ISS ESG
Identifier	
Bloomberg	tdb
ISIN	tbd

Mögliche Strukturen

Zertifikat, Swap, UCITS Fonds, kapitalgarantierte IHS

Überschußrenditen gegenüber Geldmarkt, inkl	. Transaktionskosten,	Management Fee nicht enthalten,	Daten bis 31. M2rz 2022

Return und Risiko									Strategiekennzahler	1
<u> </u>	1 Monat	3 Monate	6 Monate	9 Monate	1 Jahr	2 Jahre	3 Jahre	seit Start	Rendite	198,50%
Rendite	-0,24%	-10,30%	-6,59%	-5,90%	1,87%	60,91%	33,87%	198,50%	Rendite p.a.	10,21%
Aktien*	1,00%	-6,02%	1,08%	1,94%	8,49%	48,58%	29,10%	120,82%	Volatilität	17,55%
Rendite p.a.	_	_	_	_	1,87%	26,85%	10,18%	10,21%	Sharpe Ratio	0,58
Aktien [*]	_	_	_	_	8,49%	21,89%	8,86%	7,30%	Korrelation*	0,95
Volatilität	31,11%	25,27%	20,15%	18,13%	16,61%	17,71%	20,35%	17,55%	Beta [*]	0,99
Aktien*	27,76%	23,53%	19,17%	17,12%	15,86%	17,37%	19,49%	16,84%	Max Drawdown	-40,02%
Max Drawdown	-10,03%	-19,95%	-20,14%	-20,14%	-20,14%	-20,14%	-40,02%	-40,02%	Längster Drawdowr	n 401 Tage
Aktien [*]	-8,34%	-15,86%	-15,86%	-15,86%	-15,86%	-15,86%	-35,36%	-35,36%	Value at Risk 99%	-3,24%
								*STOXX Europe 600		* zu Aktien/STOXX Europe 600

Monatli	che Rendite	2											Jährliche Rendite	
Jahr	Jan	Feb	Mrz	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	Jahr	Rendite
2011	1,19%	1,88%	-2,85%	3,41%	1,19%	-2,69%	-4,19%	-10,01%	-6,94%	6,47%	-3,23%	1,61%	2011	-14,33%
2012	5,51%	5,47%	0,05%	-0,85%	-5,57%	6,09%	2,28%	2,92%	2,10%	-0,75%	3,22%	2,23%	2012	24,47%
2013	2,93%	3,31%	0,89%	2,69%	2,62%	-2,94%	6,64%	-1,80%	4,85%	5,37%	1,14%	1,64%	2013	30,51%
2014	1,90%	7,80%	-2,66%	1,00%	2,45%	1,70%	-2,34%	2,61%	0,22%	0,41%	3,34%	-0,22%	2014	16,99%
2015	7,93%	8,37%	1,26%	0,49%	5,17%	-3,49%	3,67%	-6,57%	-4,38%	9,71%	3,08%	-2,59%	2015	23,26%
2016	-8,23%	-3,45%	1,92%	1,04%	4,50%	-5,99%	6,01%	1,46%	0,90%	-2,53%	1,57%	5,27%	2016	1,39%
2017	0,84%	2,74%	4,52%	3,73%	0,44%	-2,92%	2,95%	0,62%	2,82%	1,65%	-3,17%	1,92%	2017	17,05%
2018	-0,23%	0,05%	-2,16%	2,14%	0,87%	0,07%	-0,47%	-1,38%	-0,32%	-6,39%	-0,69%	-6,78%	2018	-14,62%
2019	6,61%	4,52%	-1,58%	2,63%	-4,30%	2,95%	-1,24%	-1,61%	3,06%	4,55%	2,76%	2,21%	2019	21,94%
2020	-0,99%	-7,58%	-18,24%	9,10%	5,53%	2,12%	3,82%	5,45%	-1,13%	-4,40%	13,77%	5,69%	2020	9,45%
2021	-1,53%	2,71%	6,75%	3,39%	4,23%	0,45%	2,92%	1,34%	-3,41%	3,51%	-2,76%	3,46%	2021	22,62%
2022	-5.32%	-5.03%	-0.24%										2022	-10.30%

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 Climate Smart Long Only

Multi-Faktor Investment mit reduziertem CO₂-Fußabdruck

März 2022

Faktorprämien haben im Gegensatz zu Alpha einen positiven Erwartungswert

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 Riskoprämien- oder Faktorkonzente diversifizieren die individuellen Risiken der Prämien und gehen

Pramie) und Roll/Ross (Arbitrage Pricing Theory) sowie in anderen Assetklassen empirisch gut belegt. Breitgefächerte Riskoprämien- oder Faktorkonzepte diversifizieren die individuellen Risiken der Prämien und gehen auf der Aktienseite u.a. auf die Arbeiten von Haugen/Baker zurück.

Traditionelle Risikoprämien Alternative Risiko-/Faktorprämien Risiko-/Faktorprämien Wint-Risiko-/Faktorprämien Momentum Momentum Miskorfrei (risk-ree) Rohstoffe Rohstoffe Währungen Aktien Untern.- Anleihen Staatsanleihen Credit Default Sw. Inflationsind. Anl.

Prämien über Assetklassen hinweg

Prämien innerhalb von Assetklassen

Strategiekonzept

Faktorbasierte Aktienauswahl nach:

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

Risiko kontrolliert:

sektorneutral

Umsetzung:

- ca. 60 Einzelaktien
- OGAW- / UCITS-fähig

• 5/10/40-Regeln erfüllt

Investieren in Zeiten des Klimawandels

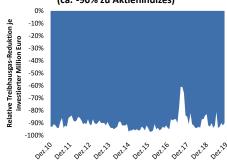
Investments sind ein Kernelement des Pariser Klimaschutzabkommens mit dem Ziel, diese in Einklang mit niedrigen Treibhausgasemissionen und klimafreundlicher Entwicklung zu bringen.

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 Veröffentlichungen zum Thema verfügbar



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



Kontakt

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

ISS FSG

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 nicht verbreitet werden darf.