

Alternatives - Februar 2019

Absolute Return Consulting GmbH, Köstlergasse 1/28, Otto-Wagner-Haus, A-1060 Wien Tel.: +43-1-52106-31, office@arc.at, www.arc.at

selected by **ARC**

Datenaufbereitung zu Informationszwecken - ausschließlich für professionelle Investoren

| Fonds | ISIN | Währung | Performance | | | | | | Volatilität | | | Start | AuM in Mio EUR |
|---------------------------------|--------------|---------|-------------|---------|---------|----------|----------|-----------------|-------------|-----|-----|--------------|----------------|
| | | | MTD | YTD | 1yr | 3yr p.a. | 5yr p.a. | seit Start p.a. | 1 yr | 3yr | 5yr | | |
| Event Driven Strategies | | | | | | | | | | | | | |
| LAFFITTE RISK ARBITRAGE | LU1602251818 | EUR | -0,24% | -0,17% | -0,64% | 0,11% | 1,55% | 2,19% | 3% | 2% | 2% | (11.12.2007) | 183 |
| LAFFITTE DYNAMIC STRATEGIES | LU1602252543 | EUR | 0,57% | 1,98% | -6,08% | - | - | -2,03% | 6% | - | - | 04.11.2016 | 39 |
| Equity Market Neutral | | | | | | | | | | | | | |
| PH. L/S EUROPE * | auf Anfrage | EUR | 1,11% | -1,00% | -0,18% | 0,47% | 1,64% | 2,23% | 3% | 3% | 3% | 11.04.2011 | 268 |
| Equity Absolute Return | | | | | | | | | | | | | |
| GIANO UCITS FUND | IE00BFX0Y988 | EUR | -5,53% | -7,40% | -8,86% | -2,85% | -1,51% | 1,48% | 9% | 10% | 10% | 25.11.2011 | 31 |
| SYCOMORE PARTNERS | FR0012365013 | EUR | 0,36% | 2,99% | -3,03% | 2,18% | 3,52% | 4,57% | 6% | 4% | 5% | 31.03.2008 | 1.107 |
| SYCOMORE L/S OPPORTUNITIES | FR0010473991 | EUR | 1,72% | 3,56% | -6,33% | 1,96% | 3,21% | 5,01% | 7% | 5% | 6% | (01.10.2010) | 648 |
| Global Macro Multi Asset | | | | | | | | | | | | | |
| ZEST ABSOLUTE RETURN VAR4 | LU0438908591 | EUR | 0,19% | 1,80% | -3,38% | 1,97% | - | 3,00% | 3% | 4% | 4% | (06.11.2008) | 64 |
| Quantitative Strategies | | | | | | | | | | | | | |
| TUNGSTEN TRYCON | LU0451958309 | EUR | -0,64% | -2,18% | -8,31% | -4,18% | -0,02% | 0,58% | 4% | 3% | 4% | (30.08.2013) | 57 |
| MU. GLOBAL MARKETS * | auf Anfrage | USD | -2,94% | -21,70% | -21,71% | -13,97% | 4,43% | 10,72% | 48% | 40% | 35% | 01.03.2002 | 37 |
| US Senior Loans | | | | | | | | | | | | | |
| PA. US SENIOR LOANS * | auf Anfrage | USD | 1,88% | 4,29% | 3,47% | 5,49% | - | 3,26% | 3% | 3% | - | 19.05.2014 | 62 |
| Katastrophenanleihen | | | | | | | | | | | | | |
| SOLIDUM CAT BOND | LI0049587301 | EUR | -0,05% | 0,38% | 0,16% | 0,14% | 0,70% | 2,28% | 1% | 5% | 4% | 30.09.2009 | 23 |
| Multi Manager | | | | | | | | | | | | | |
| mahi546 | AT0000A0W600 | EUR | 0,18% | 0,01% | -2,78% | -1,69% | -1,44% | -0,49% | 1% | 1% | 2% | 01.10.2012 | 7 |
| mahi alpha select | AT0000A21953 | EUR | 0,49% | 0,80% | - | - | - | - | - | - | - | 14.05.2018 | 2 |

* Diese Fonds sind derzeit nicht in Österreich zum öffentlichen Vertrieb zugelassen. Für nähere Informationen bitten wir um Kontaktaufnahme.

Stand: 28.02.2019

Es sind verschiedene Anteilsklassen und Währungen (auch hedged) erhältlich,- Details der ISINs gerne auf Anfrage.

Bei ZEST Absolute Return VaR4 und Laffitte Risk Arbitrage wird der Trackrecord einer länger bestehenden Retail-Klasse miteinbezogen. Details zu der Berechnung gerne auf Anfrage.

Bis August 2013 basierte der Fonds Tungsten Trycon auf einer überwiegend trendfolgenden Strategie. Seit September 2013 dominieren die aktuellen quantitativen Modelle die Strategie.

Bei Sycomore L/S Opportunities wird die Performance seit Antritt des aktuellen Portfoliomanagers am 01.10.2010 gezeigt.

Wichtige rechtliche Information - bitte lesen: Alle Daten trotz sorgfältiger Recherche ohne Gewähr. Berechnung erfolgt auf Basis der von den Gesellschaften zuletzt veröffentlichten Werte bzw. werden die Daten von externen Providern, wie Bloomberg, etc. bezogen. Die Wertentwicklung der Vergangenheit lässt keine Rückschlüsse auf die zukünftige Entwicklung eines Investments zu. Die Informationen sind nicht als Empfehlung zum Kauf/Verkauf/Halten eines Produkts, weiters nicht als Angebot zum Kauf oder als Aufforderung, ein solches Angebot zu stellen, zu verstehen. Bei diesem Informationsblatt handelt es sich ferner nicht um eine Finanzanalyse. Die veröffentlichten Prospekte und das Kundeninformationsdokumente (Wesentliche Anlegerinformationen) zu den Produkten sind in deutscher bzw. englischer Sprache kostenlos bei ARC, Köstlergasse 1/28, A-1060 Wien, erhältlich.