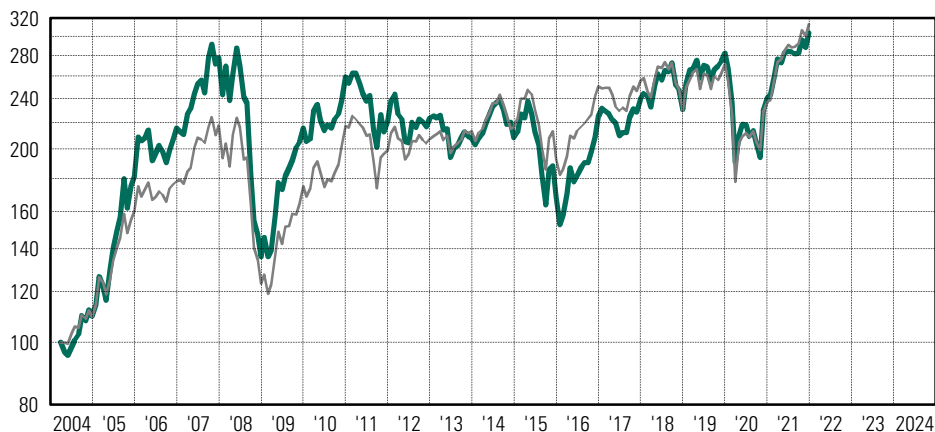


ALTIS Fund Global Resources

Performance-Übersicht in Euro

ALTIS Fund Global Resources
EUR 303,48

AC Natural Resources Index
EUR 313,03



Ertrags- und Risikokennzahlen	ALTIS Fund Global Resources	AC Natural Resources Index
31. März 2004 - 31. Dezember 2021		
Anzahl der untersuchten Monate	213	213
Arithmetischer Monatsdurchschnittsertrag (%)	0,71	0,67
Geometrischer Jahresdurchschnittsertrag (%)	6,45	6,64
Anzahl der Monate mit Gewinn	121	126
Höchster Monatsertrag (%)	18,47	14,98
Wahrscheinlichkeit eines Monatsgewinns (%)	56,8	59,2
Durchschnittsgewinn in Gewinnmonaten (%)	4,80	3,91
Erwartungswert eines Monatsgewinns (%)	2,73	2,31
Anzahl der Monate mit Verlust	92	87
Niedrigster Monatsertrag (%)	-22,18	-21,43
Wahrscheinlichkeit eines Monatsverlustes (%)	43,2	40,8
Durchschnittsverlust in Verlustmonaten (%)	4,67	4,02
Erwartungswert eines Monatsverlustes (%)	2,02	1,64
Längste Verluststrähne (Monatsanzahl)	7	5
Größter Wertverlust von einem vorherigen Höchststand (%)	53,30	46,98
Standardabweichung der Monatserträge (%)	6,10	5,14
Risikoadjustierter Ertrag (Keppler Ratio):		
Durchschnittsertrag/Verlusterwartungswert	0,35	0,41
Volatilitätsadjustierter Ertrag (Sharpe Ratio):		
Durchschnittsertrag/Standardabweichung	0,12	0,13
Differenz p.a. im Vergleich zum AC Natural Resources Index (%)	-0,19	

ALTIS Fund Global Resources

2021 Performance-Übersicht in Euro

ALTIS Fund Global Resources					AC Natural Resources Index				
Monats-ultimo	Performance Index	Ertrag pro Monat	Seit Jahres-anfang	Seit Gründung des Fonds ¹	Monats-ultimo	Performance Index	Ertrag pro Monat	Seit Jahres-anfang	Seit Gründung des Fonds ¹
Januar '21	243.01	1.14%	1.14%	143.01%	Januar '21	238.44	0.64%	0.64%	138.44%
Februar	259.78	6.90%	8.13%	159.78%	Februar	256.80	7.70%	8.39%	156.80%
März	276.04	6.26%	14.90%	176.04%	März	272.99	6.30%	15.22%	172.99%
April	272.74	-1.20%	13.52%	172.74%	April	276.27	1.20%	16.61%	176.27%
Mai	282.61	3.62%	17.63%	182.61%	Mai	284.69	3.05%	20.16%	184.69%
Juni	284.29	0.59%	18.33%	184.29%	Juni	290.33	1.98%	22.54%	190.33%
Juli	283.11	-0.42%	17.83%	183.11%	Juli	287.97	-0.81%	21.54%	187.97%
August	281.68	-0.50%	17.24%	181.68%	August	288.81	0.29%	21.90%	188.81%
September	281.80	0.04%	17.29%	181.80%	September	291.72	1.01%	23.13%	191.72%
Oktober	295.83	4.98%	23.13%	195.83%	Oktober	306.09	4.93%	29.19%	206.09%
November	288.17	-2.59%	19.94%	188.17%	November	300.19	-1.93%	26.70%	200.19%
Dezember	303.48	5.31%	26.32%	203.48%	Dezember	313.03	4.28%	32.12%	213.03%

¹ 31. März 2004

Stand: 31. Dezember 2021

KEPPLER ASSET MANAGEMENT INC. | NEW YORK

ALTIS Fund Global Resources

Asset Allocation (%)

December 31, 2021

Developed Markets	76.0
Australia	2.2
Austria	2.2
Belgium	1.6
Canada	4.6
Finland	1.0
France	2.7
Germany	4.1
Ireland	2.2
Italy	2.1
Norway	4.5
Spain	1.4
Sweden	3.8
Switzerland	1.3
United Kingdom	12.7
United States	29.7
Emerging Markets	23.0
Brazil	2.4
China	2.5
Mexico	1.9
Russia	13.0
South Africa	2.1
Thailand	1.0
Total Equity	99.0
Cash & Cash Equivalent	1.0