

Lupus alpha Volatility Risk-Premium C

Vergleichsgruppe	Absolute Return Single Strategy mit Verlusttoleranz
WKN	A1J9DU
ISIN	DE000A1J9DU7

Scope Rating



Fondsdaten

Unternehmen	Lupus alpha Investment GmbH
ISIN	DE000A1J9DU7
Auflagedatum	31.08.2015
Fondswährung	EUR
Fondsvolumen	98,2 Mio. EUR
Mindestanlage	500.000 EUR
Kurs (NAV)	129,28 EUR
Laufende Kosten	1,00%
Portfoliomanager	Stephan Steiger/Mark Ritter
SRRI	5
Erfolgsabhängige Vergütung	Ja

Ratingpunkte

78 / 100

Rendite

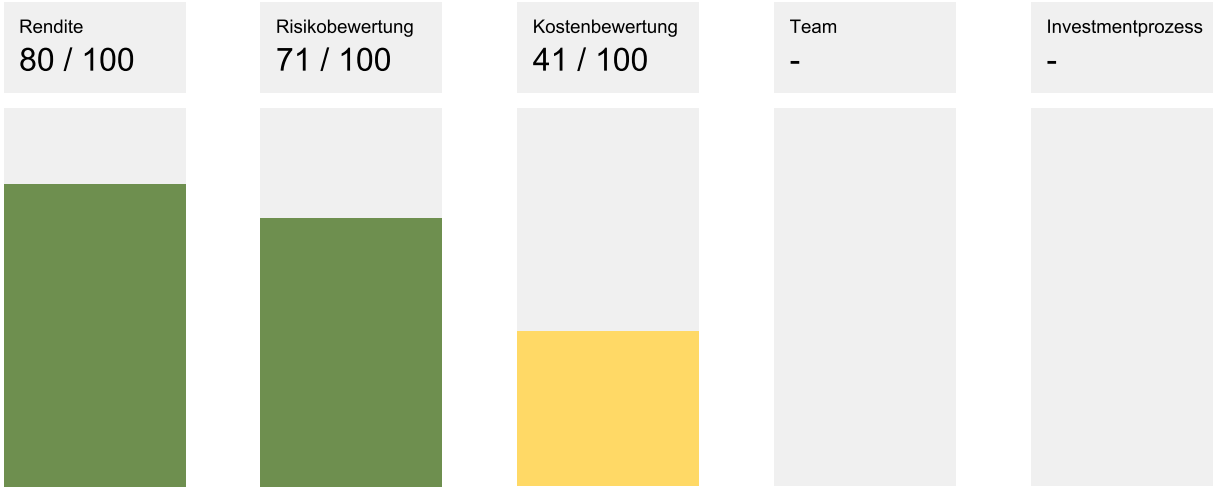
Berechnungszeitraum	Fonds	Ø
1 Jahr (p.a.)	10,65%	5,79%
3 Jahre (p.a.)	6,12%	1,53%
5 Jahre (p.a.)	3,02%	1,48%
10 Jahre (p.a.)	-	1,21%
Seit Auflage (p.a.)	3,33%	1,65%
Daten zum: 31.03.2024	Währung: EUR 2,24%	1,98%

Risiko

Kennzahl und Periode	Fonds	Ø
Max Drawdown 3 Jahre	-5,97%	-3,30%
Max Drawdown 5 Jahre	-21,52%	-7,90%
Volatilität 1 Jahr (p.a.)	2,09%	2,12%
Volatilität 3 Jahre (p.a.)	5,13%	3,14%
Volatilität 5 Jahre (p.a.)	9,71%	4,40%
Daten zum: 31.03.2024	Währung: EUR	

Strategie

Der Lupus alpha Volatility Risk-Premium setzt auf eine intelligente Optionsstrategie, die auf die Vereinnahmung der Risikoprämie Volatilität (Implied-Realised Spread) abzielt. Diese Risikoprämie ist ökonomisch begründbar, nachhaltig positiv und kann über den Handel börsennotierter Aktien-Index-Optionen vereinnahmt werden. Die Basisanlage der Strategie besteht aus kurzlaufenden Euro-Anleihen mit sehr hoher Schuldnerqualität. Die Strategie wird jeweils separat auf verschiedenen Aktienmärkten weltweit aufgesetzt.



Crash Drawdown

