

## München

Tel: +49 89 998 471 0  
Fax: +49 89 998 471 38

[munich@absoluteplus.com](mailto:munich@absoluteplus.com)

## Zürich

Tel: +41 44 267 90 10  
Fax: +41 44 261 72 88

[zurich@absoluteplus.com](mailto:zurich@absoluteplus.com)

[www.absoluteplus.com](http://www.absoluteplus.com)

## Fondsdaten

Strategie	CTA
Auflagedatum	März -2006
Mindestinvestment	EUR15.000
ISIN	LU0232558717
WKN	A0HGVX
Rechenwert	EUR1.314,54
Zeichnung	wochentlich
Rückgabe	wochentlich
Management	Winton Capital Management

## Strategie

Manager des Luxemburger Umbrellafonds "European SICAV Alliance" ist RPM Risk&Portfolio Management AB. Für den Subfonds "Global Futures Fund" wurde Winton Capital Management als Handelsberater bestellt. Die Strategie entspricht dem Winton Futures Fund.

## Monatliche Erträge (netto nach Fondsgebühren)

	2010	2009	2008	2007	2006
Jan	-1,35%	1,14%	3,11%	4,12%	
Feb	-0,36%	-0,55%	4,43%	0,58%	
Mar		-2,14%	4,00%	-11,17%	-1,34%
Apr		-4,22%	-0,93%	5,03%	6,63%
Mai		-1,87%	1,68%	3,36%	-2,68%
Jun		-1,12%	4,38%	1,80%	-1,15%
Jul		0,37%	-5,08%	-1,94%	-1,36%
Aug		0,55%	-3,02%	-1,30%	2,10%
Sep		2,06%	0,99%	5,57%	0,36%
Oct		-0,68%	5,90%	4,32%	0,07%
Nov		3,58%	4,11%	3,11%	1,31%
Dec		-2,42%	1,28%	-1,54%	3,45%
YTD	-1,71%	-5,41%	22,23%	11,25%	7,28%

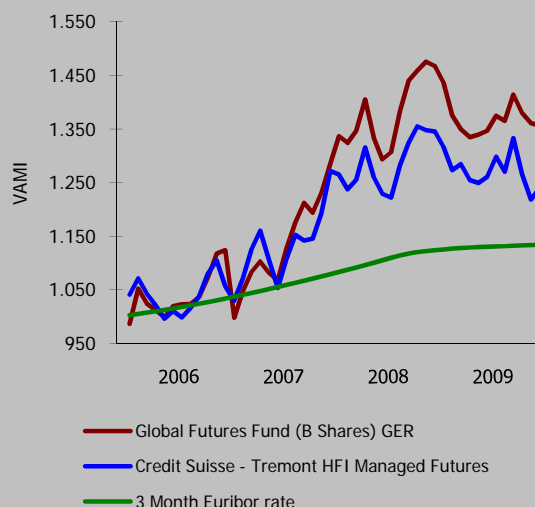
## Benchmark Analyse

	Benchmark 1	Benchmark 2
Alpha	0,3%	-0,9%
Annualized Alpha	3,9%	-9,9%
Beta	0,8	5,9
Correlation	0,7	0,2
R-squared	0,5	0,1

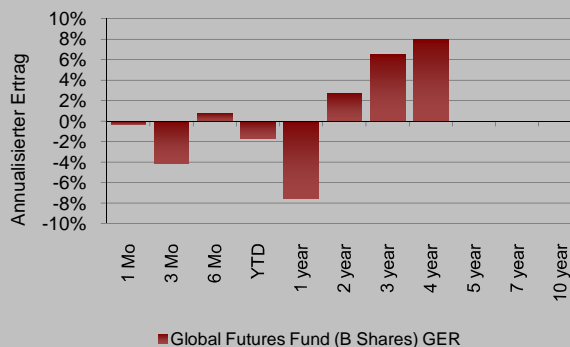
## Risiko/Ertragszahlen

	Fund	BM1	BM2
Annualisierter Durchschnittsertrag	7,92%	5,52%	3,19%
Volatilität	11,44%	11,2%	0,4%
Sharpe Ratio (3.0%)	-34,04	-35,10	-902,14
Sortino Ratio (3.0%)	-0,22	-0,49	-3,37
Downside Deviation (0%)	8,71%	8,47%	1,90%
Prozent positive Monate	58,33%	52,1%	100,0%
Bester Monat	6,63%	6,61%	0,43%
Schlechtester Monat	-11,17%	-5,0%	0,0%
Maximaler Verlust	-11,17%	-10,1%	0,0%
Durchschnittlicher monatlicher Ertrag	0,69%	0,50%	0,26%

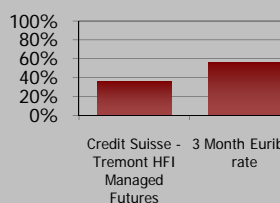
## Kumulierter Ertrag



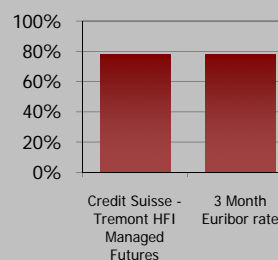
## Performance



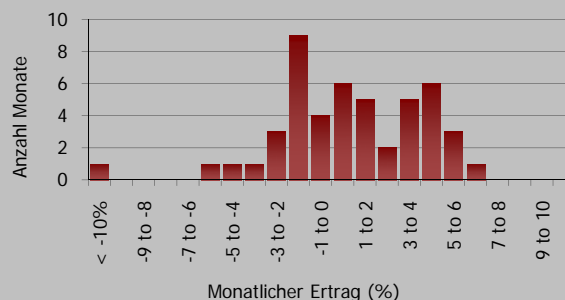
## Up Mkt Outperformance (% Monate)



## Down Mkt Outperformance (% Monate)



## Verteilung der Erträge



Diese Übersicht wurde von der Absolute Plus AG erstellt und ist weder als Verkaufsprospekt noch als Angebot zu verstehen. Die in diesem Bericht beschriebenen Gedanken und Ausführungen stellen lediglich allgemeine Informationen, jedoch keinesfalls irgendeine Form der Beratung oder Empfehlung dar. Die in diesem Bericht enthaltenen Informationen stammen aus Quellen, die als zuverlässig gelten. Sie erheben jedoch keineswegs den Anspruch der Richtigkeit und Vollständigkeit, weshalb sie auch nur bedingt verlässlich sind. Die Absolute Plus AG und die mit ihr verbundenen Gesellschaften übernehmen keinerlei Haftung für Nachteile, die direkt aus der Verwendung dieses Dokuments oder seines Inhalts entstehen.