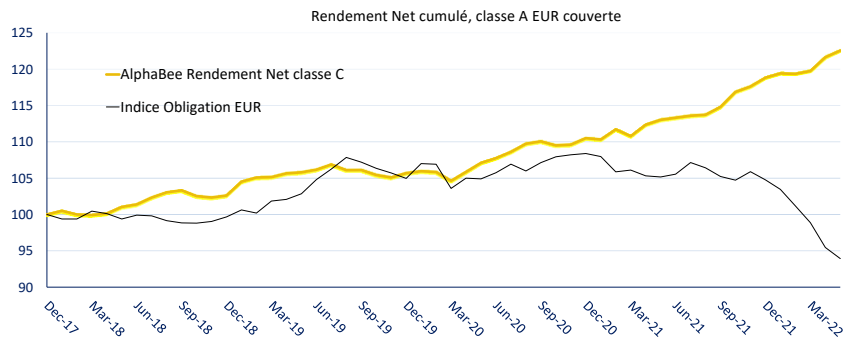


AlphaBee Multi Arbitrage (AMA) est une Sicav-SIF réglementée et auditée investissable pour les investisseurs institutionnels, professionnels ou bien informés / avertis. AMA a pour philosophie d'investissement de « Protéger et faire croître » son capital grâce à une faible volatilité, une liquidité mensuelle et des rendements ajustés au risque attractant. AMA identifie, analyse et investit dans des stratégies d'investissement d'arbitrage sur les actifs liquides, non corrélées aux marchés financiers et entre elles. La préférence est donnée aux stratégies systématiques et à celles qui profitent des niveaux de volatilité sur les marchés financiers. La Sicav-SIF gère activement un portefeuille d'une vingtaine de stratégies multi-actifs auditées dont le capital est alloué dans le but d'obtenir un portefeuille robuste et efficient, conçu pour performer dans divers régimes de marché.

* Pro-forma se basant sur la Valeur Nette d'Inventaire (VNI) de la classe A ajustée des frais avant le lancement de la classe au 30 Nov. 2021

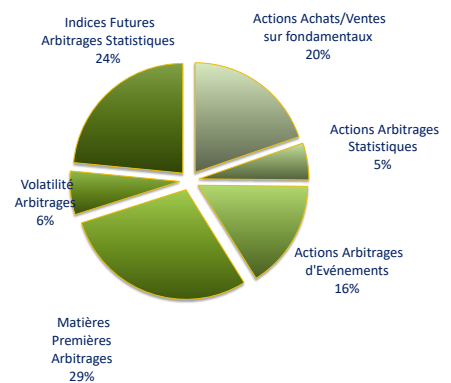
Rendements Nets classe C EUR couverte *					
	2018	2019	2020	2021	2022
Janv	0.50%	1.85%	0.25%	-0.17%	0.50%
Févr	-0.50%	0.55%	-0.11%	1.27%	-0.05%
Mars	-0.07%	0.05%	-1.15%	-0.84%	0.33%
Avr	0.21%	0.50%	1.18%	1.43%	1.59%
Mai	0.90%	0.13%	1.18%	0.60%	0.75%
Juin	0.34%	0.35%	0.61%	0.25%	
Juil	0.94%	0.66%	0.79%	0.24%	
Août	0.70%	-0.73%	1.03%	0.12%	
Sept	0.27%	0.02%	0.30%	0.95%	
Oct	-0.76%	-0.64%	-0.51%	1.79%	
Nov	-0.20%	-0.33%	0.10%	0.65%	
Dec	0.27%	0.57%	0.81%	1.03%	
YTD	2.61%	3.00%	4.55%	7.53%	3.14%



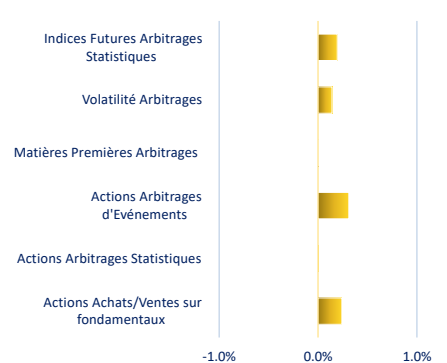
¹ L'Indice Obligataire EUR est le "SPDR® Bloomberg Barclays Euro Aggregate Bond UCITS ETF (EUR)"; ² L'Indice Action EUR est l'"EuroStoxx 600", cet indice est investible seulement via un ETF dont les coûts associés ne sont pas inclus.

Analyses Statistiques	AMA	Indice Obligataire EUR ¹	Eurostoxx 600 Index ²
Rendement Annualisé (Net)	4.7%	-1.4%	3.0%
Rendement Mensuel Moyen (r)	0.4%	-0.1%	0.4%
Ecart-Type	2.3%	4.1%	15.7%
Asymétrie	0.0	-0.6	-0.4
Kurtosis	-0.03	0.5	2.4
Rendement Cumulé	23%	-6%	14%
Sharpe (Rf.-0,1%) pa.	2.2	-0.2	0.3
Sortino (Rf.-0,1%) pa.	8.9	-0.3	0.8
VaR Annuelle @ 99%	-1.2%	-2.9%	-10.2%
Perte maximale cumulée	-2.1%	-13.3%	-23.0%
Ratio Calmar	2.4	-0.2	0.3
Largest Month Gain	1.9%	1.9%	13.7%
Perte du pire mois	-1.2%	-3.5%	-14.8%
% Mois positifs	75%	45%	57%
% Mois négatifs	25%	55%	43%

Allocation par stratégies principales

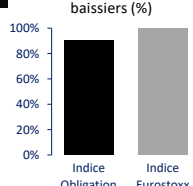
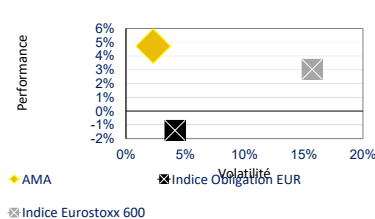
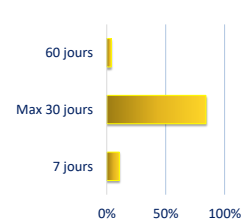


Contributions au Rendement (MTD)


AMA Analyses

Alpha mensuel
Alpha annualisé
Beta
Corrélation
Taux de détermination
Prime Active
Treydor
Jensen Alpha Annualisé

vs

Indice Obligataire EUR¹
Eurostoxx 600 Index²
Surperformance vs Benchmarks - mois baissiers (%)

Proxy Rendement/Risque

Liquidité du Portefeuille (%)


AlphaBee Asset Management
Fund

www.alphabee.fund



30, Dernier Sol
L-2543 Luxembourg
+352 661 841 035
info@alphabee.fund

Structure légale		Dépositaire & Admin		Auditeur		Gérant (AIFM)	
SICAV-SIF, num. 000011182 (CSSF)		Caceis Bank, Luxembourg		Ernst & Young, Luxembourg		AlphaBee Asset Management, num. A00001983 (CSSF)	
Classe	Frais de Gestion	Frais de Performance	Monnaie	Notification remboursement	Investment initial	ISIN	Ticker Bloomberg
A	1% p.a.	10% p.a.	USD	65 days	USD 1m	LU1619416628	ALMAUEB LX
A	1% p.a.	10% p.a.	EUR Hedged	65 days	USD 1m	LU1619416891	ALMAAEH LX
A	1% p.a.	10% p.a.	CHF Hedged	65 days	USD 1m	LU1619416974	ALMAACH LX
A	1% p.a.	10% p.a.	GBP Hedged	65 days	USD 1m	LU1619417196	ALMAAGH LX
B	0% p.a.	30% p.a.	USD	65 days	USD 1m	LU1619417279	
C	1,5% p.a.	15% p.a.	EUR Hedged	45 days	EUR 125k	LU2399848279	ALMACEH LX
C	1,5% p.a.	15% p.a.	CHF Hedged	45 days	EUR 125k	LU2399848352	
C	1,5% p.a.	15% p.a.	GBP Hedged	45 days	EUR 125k	LU2399848436	
C	1,5% p.a.	15% p.a.	USD	45 days	EUR 125k	LU2399848196	

En consultant une copie de ce document, vous êtes liés par les règles et conditions suivantes : Ce document a été préparé par AlphaBee Asset Management Fund (« AlphaBee ») uniquement dans le but de fournir des informations générales à la personne prévue et livrée. Ni le document ni les informations qu'il contient ne peuvent être transmis, reproduits, distribués ou publiés par quiconque à quelque fin que ce soit sans le consentement écrit préalable d'AlphaBee. Il est uniquement destiné à des fins d'éducation générale, d'illustration et de discussion et ne tente en aucun cas d'énoncer des termes et conditions potentiels concernant toute collaboration contractuelle sous quelque forme que ce soit avec AlphaBee. EN PARTICULIER, CE DOCUMENT NE FOURNIT AUCUN CONSEIL OU OFFRE. En liaison avec la Directive européenne 2011/61/UE relative aux gestionnaires de fonds d'investissement alternatifs, ce document s'adresse uniquement aux investisseurs éligibles, c'est-à-dire ayant le statut d'investisseurs institutionnels, professionnels ou avertis. AlphaBee ne prend pas en considération les impacts négatifs des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité en vertu du règlement (UE) 2019/2088 du Parlement européen et du Conseil sur les informations à fournir en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (« SFDR »), car cette considération n'est à ce jour pas applicable et faisable dans l'analyse, la construction de portefeuille et la gestion des risques qu'AlphaBee entreprend dans le meilleur intérêt de ses clients et en pleine conformité avec ses obligations fiduciaires d'optimiser un rendement donné pour un risque donné. AlphaBee continue de surveiller si et dans quelle mesure une telle considération peut être mise en œuvre à l'avenir. Ce document n'est pas destiné au grand public et n'est pas destiné à être distribué aux États-Unis (« États-Unis ») ou pour le compte de personnes des États-Unis telles que définies dans le règlement S en vertu du US Securities Act de 1933. La description incluse dans le présent document et tout autres documents fournis ne sont pas destinés à être complets ou exacts. Aucune représentation, garantie ou engagement, explicite ou implicite, n'est donné quant à l'impartialité, l'exactitude ou l'exhaustivité des informations ou opinions contenus dans ce document et aucune confiance ne peut être accordée à quelque fin que ce soit aux informations contenues dans ce document. LES PERFORMANCES PASSÉES NE SONT PAS UN INDICATEUR FIABLE DES PERFORMANCES FUTURES. Il n'y a aucune obligation de mettre à jour, modifier ou amender ce document. Rien dans les présentes ne sera réputé lier, ou créer des obligations ou un engagement de la part d'AlphaBee.