

## SUPERFUND BLUE USD BEENDETE DEN MONAT DEZEMBER MIT EINER PERFORMANCE VON -8,21 %

Superfund Blue ist eine selbstentwickelte Aktienstrategie mit Absicherungssystem gegen fallende Märkte. Ziel sind kontinuierliche Erträge bei relativ geringer Volatilität unabhängig von der jeweiligen Marktsituation. Die Strategie investiert in ausgewählte Einzelaktien, die ein höheres Ertragspotenzial erwarten lassen als der Gesamtmarkt bei gleichzeitiger Absicherungsmöglichkeit gegen Verluste mit dem jeweiligen Aktienindex Future. Die vollautomatische Superfund Blue Handelsstrategie investiert an den größten Aktienbörsen weltweit, vor allem in Europa, den USA und Asien. Aufgrund der geringen Korrelation zu anderen Anlageklassen in Verbindung mit dem stabilen Ertragspotential eignet sich Superfund Blue zur effektiven Diversifikation von Wertpapierportfolios.

### INDEXENTWICKLUNG

*Handelsbeginn: 01.07.2015, NAV/Index: 1.000,00*

	Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	
<b>2015</b>							932,64	979,73	904,89	894,74	870,54	869,07	<b>-13,09 %</b>
<b>2016</b>	870,50	873,47	886,02	914,92	917,90	906,88	922,17	887,29	915,81	870,97	893,94	879,40	<b>1,19 %</b>
<b>2017</b>	875,37	877,69	889,73	858,93	857,64	871,79	861,54	842,58	838,54	818,87	802,55	802,84	<b>-8,71 %</b>
<b>2018</b>	811,14	808,45	795,54	799,06	780,83	761,91	757,12	752,03	744,37	673,31	669,32	614,35	<b>-23,48 %</b>

### PERFORMANCEENTWICKLUNG

	Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	
<b>2015</b>							-6,74 %	5,05 %	-7,64 %	-1,12 %	-2,70 %	-0,17 %	<b>-13,09 %</b>
<b>2016</b>	0,17 %	0,34 %	1,44 %	3,26 %	0,33 %	-1,20 %	1,69 %	-3,78 %	3,21 %	-4,90 %	2,64 %	-1,63 %	<b>1,19 %</b>
<b>2017</b>	-0,46 %	0,27 %	1,37 %	-3,46 %	-0,15 %	1,65 %	-1,18 %	-2,20 %	-0,48 %	-2,35 %	-1,99 %	0,04 %	<b>-8,71 %</b>
<b>2018</b>	1,03 %	-0,33 %	-1,60 %	0,44 %	-2,28 %	-2,42 %	-0,63 %	-0,67 %	-1,02 %	-9,55 %	-0,59 %	-8,21 %	<b>-23,48 %</b>

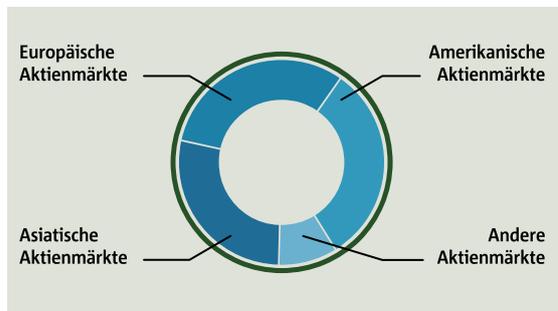
Angeführte Performance-Daten sind Nettowerte nach Abzug der Gebühren (exkl. Agio bzw. vor Abzug etwaiger Steuern).

Ein Agio in Höhe von 4% führt zu einer entsprechenden Verringerung der Rendite. **Angaben zur früheren Wertentwicklung sind -bezogen auf einen derart kurzen Zeitraum - kein verlässlicher Indikator für künftige Ergebnisse.**



logarithmische Darstellung

Quelle: Superfund, Teletrader; Zeitraum: 01.07.2015 - 31.12.2018



Schematische Darstellung. Die tatsächliche Diversifikation wird laufend an die aktuelle Marktsituation angepasst.

### ERTRAGS Kennzahlen

Seit Handelsbeginn	-38,56 %
Performance p.a.	-12,98 %
Seit Jahresbeginn	-23,48 %
12-Monatsperformance	-23,48 %
Durchschnittl. Monatsperformance	-1,15 %
Beste Monatsperformance	5,05 %

### RISIKO Kennzahlen

Volatilität p.a.	10,41 %
Monatl. Standardabweichung	3,01 %
Max. Positionsgröße einer Aktie	10%
Max. Leverage	400%
Ø Investitionsgrad in diesem Monat	89,68 %
Max. Wertverlust	38,56 %
% positive Monate	35,71 %

### STATISTIK Kennzahlen

Sharpe Ratio **	-1,25
Sharpe Ratio (1 Jahr) **	-2,04
Sortino Ratio p.a. **	-1,46
Sortino Ratio (1 Jahr) **	-2,13
Korrelation zu S&P500	0,35
Korrelation zu Hang Seng	0,24
Korrelation zu EURO STOXX 50	0,08
Korrelation zu Managed Futures Index <sup>1</sup>	-0,27
Korrelation zu Equity Market Neutral Index <sup>2</sup>	-0,03

\*\* modifiziert (risikofreie Rendite = 0%)

1) CISDM CTA Equal Weighted Index

2) CISDM Equity Market Neutral Index

### Fund Facts

GMP - Superfund Blue - C - USD	
ISIN:	LU1103314289
Ausgabeaufschlag:	4 %
Verwaltungsgebühr:	0,167 % p.m.
Gewinnbeteiligung (High-Water-Mark):	30 %
Empfohlene Haltedauer:	mind. 6 Jahre
Liquidität:	täglich
Währung:	USD
Fondstyp:	UCITS
Auditor:	Deloitte Audit SARL
Verwaltungsgesellschaft:	Casa4Funds S.A.
Investment Manager:	Superfund Asset Management GmbH
Depotbank:	ING Luxembourg S.A.
Homepage:	www.superfund.com



**Marketingmitteilung:** Diese dient ausschließlich der unverbindlichen Information und stellt kein Angebot, kein Angebot zu Einladung zur Abgabe eines Angebots, keine Anlageberatung sowie keine Aufforderung zum Kauf, Halten oder Verkauf dar und ersetzt kein individuelles Beratungsgespräch. Vor Treffen der Veranlagungsentscheidung sollte jedenfalls ein professioneller Finanzdienstleister beigezogen werden. Der Prospekt des Fonds Global Managers Platform Superfund Blue kann in englischer Sprache, die wesentliche Anlegerinformation (KIID) kann in deutscher und englischer Sprache, in der aktuell gültigen Fassung, am Sitz der Superfund Asset Management GmbH, 1010 Wien, Marc-Aurel Str. 10-12, kostenlos bezogen werden. **Risikohinweis:** Eine Investition in alternative Aktienfonds im Allgemeinen bzw. in Superfund Blue Finanzprodukte im Besonderen ist mit erheblichen marktbedingten Risiken verbunden, die bis zum Totalverlust des eingesetzten Kapitals reichen können. Die Investitionen des Fonds zur Umsetzung der Handelsstrategie erfolgen mittels SWAP-Agreements, wodurch ein zusätzliches Emittentenrisiko in Hinblick auf die jeweilige Gegenpartei hinzutritt. Die Fonds können über den Einsatz von Derivaten aufgrund deren Hebelwirkung die Auswirkungen der Wertschwankungen von Einzelaktien auf das Fondsvolumen auf ein Vielfaches der Wertschwankung der Einzelaktie erhöhen. Dies bietet Anlegern höhere Chancen, bedingt aber auch höhere Wertschwankungen und Risiken als ohne Hebelwirkung. Wertverluste im Ausmaß von 10-15 % sind jederzeit möglich, aber auch darüber hinaus gehende Wertverluste sind aufgrund des Einsatzes von Leverage (Hebel) bis zum Totalverlust möglich. Quelle: Superfund, Teletrader