

vormals: Superfund B Genussschein

SUPERFUND GREEN B GENUSSSCHEIN¹ BEENDETE DEN MONAT DEZEMBER MIT EINER PERFORMANCE VON 0,07 %

Superfund Green setzt vorwiegend mittel- bis langfristige Trendfolgestrategien ein und handelt auf rund 150 liquiden Finanz- und Rohstoffmärkten weltweit. Zur weiteren Diversifikation wird auch in kurzfristige Strategien wie Prognosemodelle, Counter-Trend und kurzfristige Trendfolge investiert. Ziel dieser Managed Futures Strategie sind hohe Erträge bei sowohl steigenden als auch fallenden Märkten und eine Volatilität von rund 35 % p.a. Die Superfund Green Managed Futures Strategie wird seit März 1996 langfristig erfolgreich eingesetzt und basiert auf selbstentwickelten vollautomatischen Handelssystemen, wodurch emotionale Fehlentscheidungen ausgeschlossen werden. Durch systematische Risikokontrolle werden das Gesamtrisiko sowie alle Einzelpositionen permanent kontrolliert und entsprechend der Marktvolatilitäten laufend angepasst. Aufgrund der langfristig geringen Korrelation zu anderen Anlageklassen eignet sich Superfund Green hervorragend zur Portfolio-Beimischung.

PERFORMANCEENTWICKLUNG

Handelsbeginn: 01.10.2003, NAV/Index: 1.000,00; Datum: 31.12.2018, NAV/Index: 590,19

	Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	
2003										-3,75 %	-13,59 %	15,71 %	-3,77 %
2004	1,48 %	12,74 %	-1,91 %	-23,51 %	3,90 %	-12,23 %	1,74 %	-6,35 %	4,88 %	4,06 %	15,57 %	2,13 %	-3,92 %
2005	-14,21 %	-0,20 %	4,42 %	-15,44 %	3,84 %	3,73 %	-0,71 %	-0,63 %	1,02 %	-12,48 %	12,94 %	3,39 %	-17,04 %
2006	8,83 %	-5,79 %	2,65 %	7,10 %	-6,63 %	-4,46 %	-14,40 %	-1,26 %	9,02 %	7,49 %	-0,50 %	14,18 %	13,16 %
2007	2,32 %	-10,01 %	-6,69 %	11,05 %	6,18 %	5,37 %	-11,87 %	-11,16 %	8,06 %	13,39 %	-7,46 %	3,84 %	-1,58 %
2008	-4,12 %	23,60 %	1,94 %	-2,96 %	10,38 %	12,03 %	-14,36 %	-9,72 %	6,82 %	25,31 %	2,56 %	2,31 %	57,43 %
2009	1,06 %	1,11 %	-4,08 %	-10,26 %	-17,32 %	-4,34 %	-12,07 %	4,44 %	5,04 %	-14,97 %	22,60 %	-14,62 %	-40,27 %
2010	-15,02 %	2,70 %	20,53 %	7,86 %	-21,80 %	0,46 %	-3,27 %	6,39 %	5,77 %	8,21 %	-3,78 %	16,41 %	17,60 %
2011	-5,49 %	7,35 %	-0,66 %	13,41 %	-13,41 %	-3,07 %	9,30 %	1,05 %	-4,83 %	-16,48 %	-5,32 %	-6,16 %	-25,17 %
2012	-0,01 %	2,87 %	-10,82 %	-0,90 %	27,92 %	-12,42 %	3,63 %	-3,43 %	-4,32 %	-6,60 %	-6,73 %	3,81 %	-11,81 %
2013	6,54 %	1,21 %	2,33 %	17,70 %	-11,91 %	-4,65 %	0,67 %	-2,77 %	-3,78 %	4,11 %	0,87 %	2,69 %	10,79 %
2014	-4,34 %	6,20 %	-4,81 %	-1,41 %	2,25 %	-0,47 %	-2,60 %	9,82 %	2,77 %	-1,18 %	12,37 %	-2,32 %	15,71 %
2015	6,96 %	3,59 %	1,57 %	-3,31 %	-0,93 %	-11,31 %	7,77 %	-10,21 %	0,45 %	2,50 %	8,78 %	-3,56 %	-0,07 %
2016	0,65 %	2,37 %	-2,48 %	-8,14 %	-3,77 %	1,15 %	4,73 %	-4,50 %	-2,68 %	-8,10 %	-2,73 %	-1,69 %	-23,14 %
2017	-0,02 %	4,47 %	-0,55 %	0,17 %	1,66 %	-3,23 %	5,08 %	2,92 %	-0,97 %	11,05 %	0,74 %	2,54 %	25,78 %
2018	7,70 %	-11,72 %	1,72 %	-0,64 %	-3,15 %	-2,57 %	0,54 %	-1,18 %	-5,00 %	-11,32 %	0,65 %	0,07 % [*]	-23,56 %

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

^{*} vorläufiger Monatsendwert

Ein Agio in Höhe von bis zu 7% führt zu einer entsprechenden Verringerung der Rendite. Frühere Wertentwicklungen sind kein verlässlicher Indikator für künftige Ergebnisse.



logarithmische Darstellung

Quelle: Superfund, Teletrader; Zeitraum: 01.10.2003 - 31.12.2018

ERTRAGS Kennzahlen

Seit Handelsbeginn	-40,98 %
Performance p.a.	-3,40 %
Seit Jahresbeginn	-23,56 %
12-Monatsperformance	-23,56 %
Durchschnittl. Monatsperformance	-0,29 %
Beste Monatsperformance	27,92 %

RISIKO Kennzahlen

Volatilität p.a.	29,87 %
Monatl. Standardabweichung	8,62 %
Max. Anfangsrisiko pro Position	1,50 %
Typical margin to equity	30 %
Max. Wertverlust	57,36 %
% positive Monate	51,37 %

STATISTIK Kennzahlen

Sharpe Ratio **	-0,11
Sharpe Ratio (1 Jahr) **	-1,25
Sortino Ratio p.a. **	-0,18
Sortino Ratio (1 Jahr) **	-1,58
Korrelation zu S&P500	0,07
Korrelation zu Hang Seng	0,00
Korrelation zu EURO STOXX 50	0,06
Korrelation zu Managed Futures Index ²	0,78
Korrelation zu Equity Market Neutral Index ³	0,19

** modifiziert (risikofreie Rendite = 0%)

2) CISM Equal Weighted Index

3) CISM Equity Market Neutral Index

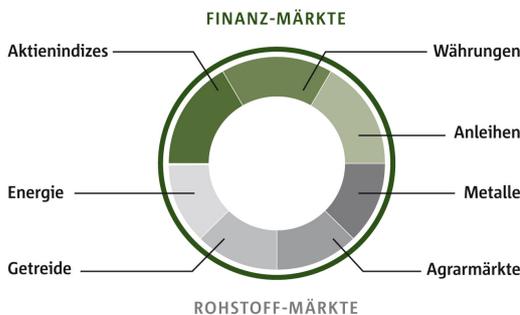
Fund Facts

ISIN:	AT0000641170
Managementgebühr:	0,4 % p.m.
Gewinnbeteiligung:	25 %
Empf. Haltedauer:	mind. 6 Jahre
Kündigung:	monatlich
Währung:	EUR
Zahlstelle:	Liechtensteinische Landesbank (Österreich) AG
Auditor:	KPMG Austria
Trading Advisor:	Superfund Investment Management Inc.
Homepage:	www.superfund.com

WERTENTWICKLUNG

der vergangenen 12-Monats-Perioden

31.12.2013 - 31.12.2014	15,71 %
31.12.2014 - 31.12.2015	-0,07 %
31.12.2015 - 30.12.2016	-23,14 %
30.12.2016 - 29.12.2017	25,78 %
29.12.2017 - 31.12.2018	-23,56 %



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



1) Wichtiger Hinweis: Beim Superfund B handelt es sich um einen geschlossenen Fonds. Zeichnungen von Superfund B Genussscheinen einschließlich Folgeinvestments sind ausnahmslos nicht mehr möglich und werden nicht mehr akzeptiert. Die Emission dieser Wertpapiere ist somit bereits abgeschlossen. Die auf diesem Fact Sheet veröffentlichten Angaben über die Superfund B Genussscheine dürfen somit nicht als Angebot welcher Art auch immer in Bezug auf den Erwerb dieser Genussscheine aufgefasst werden, sondern dienen lediglich der Information bestehender Investoren. Die angegebenen Kurse verstehen sich netto nach Abzug der Gebühren beziehungsweise vor Abzug etwaiger Steuern. Entwicklungen der Vergangenheit sind keine Garantie für eine zukünftige Gewinnentwicklung. Auch ein Totalverlust des eingesetzten Kapitals kann nicht ausgeschlossen werden. Alle Angaben vorbehaltlich etwaiger Druckfehler. Quelle: Superfund, Teletrader