

vormals: Superfund Cayman

## SUPERFUND GREEN MASTER<sup>1</sup> BEENDETE DEN MONAT DEZEMBER MIT EINER PERFORMANCE VON 0,83 %

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 50 % 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.

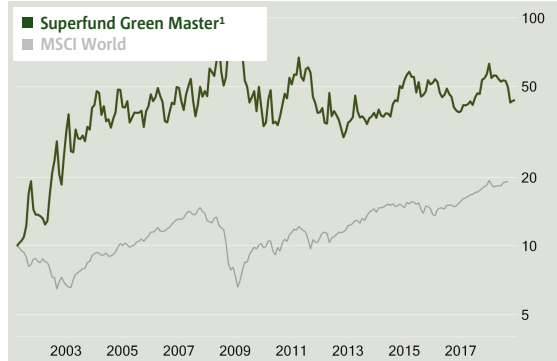
### PERFORMANCEENTWICKLUNG

Handelsbeginn: 03.05.2001, NAV/Index: 10,00; Datum: 31.12.2018, NAV/Index: 43,69

	Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	Kumuliert	
<b>2001</b>					3,15 %	2,42 %	3,92 %	11,76 %	38,38 %	13,41 %	-24,59 %	-5,44 %	<b>37,30 %</b>	<b>37,30 %</b>
<b>2002</b>	-0,02 %	-1,48 %	-2,18 %	-5,98 %	3,71 %	30,37 %	24,09 %	13,54 %	21,55 %	-28,02 %	-10,24 %	32,70 %	<b>79,84 %</b>	<b>146,93 %</b>
<b>2003</b>	27,42 %	20,27 %	-31,14 %	-1,03 %	25,76 %	-8,29 %	-0,98 %	3,64 %	-5,57 %	15,63 %	-2,78 %	24,60 %	<b>63,50 %</b>	<b>303,73 %</b>
<b>2004</b>	2,89 %	14,98 %	-1,71 %	-19,92 %	9,27 %	-14,21 %	2,06 %	-8,12 %	9,39 %	6,82 %	25,74 %	-0,29 %	<b>19,91 %</b>	<b>384,11 %</b>
<b>2005</b>	-15,92 %	-0,53 %	6,60 %	-19,41 %	4,99 %	5,41 %	-0,30 %	0,15 %	2,05 %	-15,12 %	17,29 %	5,08 %	<b>-15,24 %</b>	<b>310,31 %</b>
<b>2006</b>	12,82 %	-6,73 %	4,14 %	9,66 %	-7,64 %	-5,99 %	-17,56 %	-1,14 %	11,12 %	9,69 %	-1,51 %	18,91 %	<b>21,40 %</b>	<b>398,12 %</b>
<b>2007</b>	-0,85 %	-12,76 %	-8,32 %	16,84 %	8,98 %	7,51 %	-19,67 %	-14,70 %	12,30 %	19,98 %	-9,50 %	5,79 %	<b>-4,02 %</b>	<b>378,08 %</b>
<b>2008</b>	-5,00 %	32,16 %	-3,38 %	-3,93 %	16,29 %	17,77 %	-24,06 %	-12,80 %	8,93 %	36,21 %	5,82 %	4,96 %	<b>74,18 %</b>	<b>732,71 %</b>
<b>2009</b>	1,35 %	1,81 %	-6,65 %	-13,59 %	-23,29 %	-5,93 %	-14,88 %	5,55 %	6,27 %	-18,32 %	27,97 %	-18,30 %	<b>-51,03 %</b>	<b>307,80 %</b>
<b>2010</b>	-17,73 %	3,76 %	25,94 %	10,07 %	-28,37 %	1,53 %	-3,41 %	9,06 %	12,41 %	12,03 %	-4,51 %	22,98 %	<b>34,07 %</b>	<b>446,74 %</b>
<b>2011</b>	-6,49 %	10,57 %	-0,42 %	19,19 %	-17,72 %	-3,75 %	12,46 %	1,57 %	-5,34 %	-21,46 %	-6,16 %	-9,35 %	<b>-29,79 %</b>	<b>283,87 %</b>
<b>2012</b>	0,57 %	4,38 %	-13,92 %	-0,59 %	36,11 %	-20,86 %	5,22 %	-3,93 %	-4,73 %	-8,38 %	-8,44 %	5,79 %	<b>-17,29 %</b>	<b>217,51 %</b>
<b>2013</b>	9,44 %	2,11 %	3,62 %	24,32 %	-14,69 %	-6,07 %	1,18 %	-2,79 %	-4,77 %	6,01 %	1,84 %	3,64 %	<b>20,89 %</b>	<b>283,84 %</b>
<b>2014</b>	-4,93 %	8,74 %	-5,74 %	-1,34 %	3,49 %	-0,24 %	-2,92 %	13,20 %	4,16 %	-0,98 %	16,56 %	-2,18 %	<b>28,26 %</b>	<b>392,32 %</b>
<b>2015</b>	8,85 %	5,23 %	3,02 %	-4,95 %	-0,11 %	-14,55 %	11,09 %	-13,58 %	1,51 %	3,75 %	11,98 %	-4,10 %	<b>3,94 %</b>	<b>411,71 %</b>
<b>2016</b>	1,58 %	3,71 %	-2,78 %	-10,25 %	-4,41 %	2,35 %	6,55 %	-5,33 %	-2,87 %	-9,89 %	-3,21 %	-1,75 %	<b>-24,48 %</b>	<b>286,42 %</b>
<b>2017</b>	0,94 %	6,39 %	-0,19 %	1,15 %	2,89 %	-3,59 %	7,65 %	4,52 %	-0,64 %	15,19 %	1,76 %	4,08 %	<b>46,68 %</b>	<b>466,80 %</b>
<b>2018</b>	11,18 %	-13,43 %	2,61 %	-0,16 %	-3,35 %	-2,61 %	1,33 %	-0,68 %	-5,97 %	-14,45 %	1,73 %	0,83 %*	<b>-22,92 %</b>	<b>336,90 %</b>

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

\* vorläufiger Monatsendwert



logarithmische Darstellung

Quelle: Superfund, Teletrader; Zeitraum: 03.05.2001 - 31.12.2018

### ERTRAGS Kennzahlen

Seit Handelsbeginn	336,90 %
Performance p.a.	8,70 %
Seit Jahresbeginn	-22,92 %
12-Monatsperformance	-22,92 %
Durchschnittl. Monatsperformance	0,70 %
Beste Monatsperformance	38,38 %

### RISIKO Kennzahlen

Volatilität p.a.	43,41 %
Monatl. Standardabweichung	12,53 %
Max. Anfangsrisiko pro Position	2,00 %
Typical margin to equity	40 %
Max. Wertverlust	65,07 %
% positive Monate	52,36 %

### STATISTIK Kennzahlen

Sharpe Ratio **	0,20
Sharpe Ratio (1 Jahr) **	-0,94
Sortino Ratio p.a. **	0,34
Sortino Ratio (1 Jahr) **	-1,21
Korrelation zu S&P500	-0,10
Korrelation zu Hang Seng	-0,09
Korrelation zu EURO STOXX 50	-0,13
Korrelation zu Managed Futures Index <sup>2</sup>	0,80
Korrelation zu Equity Market Neutral Index <sup>3</sup>	0,15

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

2) CISDM CTA Equal Weighted Index

3) CISDM Equity Market Neutral Index

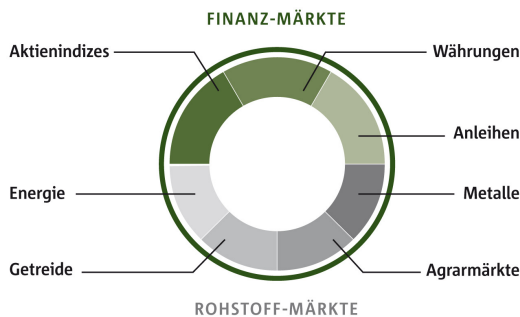
### Fund Facts

OeKB-WPKNR:	778655
ISIN:	KYG8583R1011
Managementgebühr:	1 % p.a.
Gewinnbeteiligung:	35 %
Kündigung:	wöchentlich
Trading Advisor:	Superfund Capital Management Inc., Grenada
Währung:	USD
Administrator:	Apex Fund Services (Malta) Ltd. Luxembourg Branch
Auditor:	BDO Cayman Islands
Rechtsbeistand:	Campbells
Homepage:	www.superfund.com

### WERTENTWICKLUNG

der vergangenen 12-Monats-Perioden

	Superfund Green Master <sup>1</sup>	MSCI World
31.12.2013 - 31.12.2014	28,26 %	2,93 %
31.12.2014 - 31.12.2015	3,94 %	-2,74 %
31.12.2015 - 30.12.2016	-24,48 %	5,32 %
30.12.2016 - 29.12.2017	46,68 %	20,11 %
29.12.2017 - 31.12.2018	-22,92 %	4,03 %



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



1) Beim Superfund Cayman Master Class A ("Superfund Cayman") handelt es sich um einen geschlossenen Fonds. Zeichnungen dieses Fonds einschließlich Folgeinvestments sind ausnahmslos nicht mehr möglich und werden nicht mehr akzeptiert. Die angegebenen Kurse verstehen sich netto nach Abzug der Gebühren. Entwicklungen der Vergangenheit sind keine Garantie für eine zukünftige Gewinnentwicklung. Die Finanzprodukte der Superfund Investmentgesellschaften dienen in aller Regel spekulativen Anlagezielen. Auch ein Totalverlust des eingesetzten Kapitals kann nicht ausgeschlossen werden. Die auf diesem Fact Sheet veröffentlichten Angaben dürfen nicht als Angebot welcher Art auch immer in Bezug auf den Erwerb dieses Fonds aufgefasst werden, sondern dienen lediglich der Information bestehender Investoren. Für die angeführten Angaben wird keinerlei Haftung übernommen, etwaige Druckfehler sind vorbehalten. Quelle: Superfund, Teletrader