Superfund Green Master[1]

03/2025

vormals: Superfund Cayman

SUPERFUND GREEN MASTER[1] BEENDETE DEN MONAT MÄRZ MIT EINER PERFORMANCE VON -4,92 %

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.

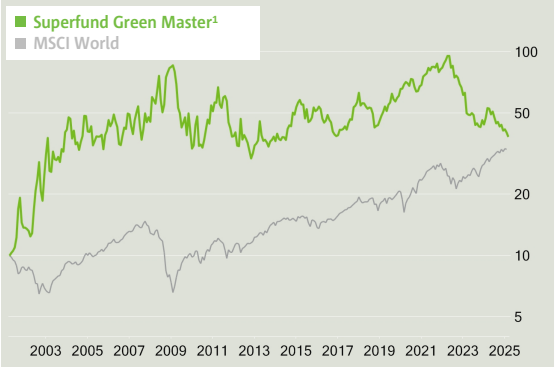
PERFORMANCEENTWICKLUNG

Handelsbeginn: 03.05.2001, NAV/Index: 10,00; Datum: 31.03.2025, NAV/Index: 38,26

	Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez		Kumuliert
2001					+3,15 %	+2,42 %	+3,92 %	+11,76 %	+38,38 %	+13,41 %	-24,59 %	-5,44 %	**+37,30 %**	**37,30 %**
2002	-0,02 %	-1,48 %	-2,18 %	-5,98 %	+3,71 %	+30,37 %	+24,09 %	+13,54 %	+21,55 %	-28,02 %	-10,24 %	+32,70 %	**+79,84 %**	**146,93 %**
2003	+27,42 %	+20,27 %	-31,14 %	-1,03 %	+25,76 %	-8,29 %	-0,98 %	+3,64 %	-5,57 %	+15,63 %	-2,78 %	+24,60 %	**+63,50 %**	**303,73 %**
2004	+2,89 %	+14,98 %	-1,71 %	-19,92 %	+9,27 %	-14,21 %	+2,06 %	-8,12 %	+9,39 %	+6,82 %	+25,74 %	-0,29 %	**+19,91 %**	**384,11 %**
2005	-15,92 %	-0,53 %	+6,60 %	-19,41 %	+4,99 %	+5,41 %	-0,30 %	+0,15 %	+2,05 %	-15,12 %	+17,29 %	+5,08 %	**-15,24 %**	**310,31 %**
2006	+12,82 %	-6,73 %	+4,14 %	+9,66 %	-7,64 %	-5,99 %	-17,56 %	-1,14 %	+11,12 %	+9,69 %	-1,51 %	+18,91 %	**+21,40 %**	**398,12 %**
2007	-0,85 %	-12,76 %	-8,32 %	+16,84 %	+8,98 %	+7,51 %	-19,67 %	-14,70 %	+12,30 %	+19,98 %	-9,50 %	+5,79 %	**-4,02 %**	**378,08 %**
2008	-5,00 %	+32,16 %	-3,38 %	-3,93 %	+16,29 %	+17,77 %	-24,06 %	-12,80 %	+8,93 %	+36,21 %	+5,82 %	+4,96 %	**+74,18 %**	**732,71 %**
2009	+1,35 %	+1,81 %	-6,65 %	-13,59 %	-23,29 %	-5,93 %	-14,88 %	+5,55 %	+6,27 %	-18,32 %	+27,97 %	-18,30 %	**-51,03 %**	**307,80 %**
2010	-17,73 %	+3,76 %	+25,94 %	+10,07 %	-28,37 %	+1,53 %	-3,41 %	+9,06 %	+12,41 %	+12,03 %	-4,51 %	+22,98 %	**+34,07 %**	**446,74 %**
2011	-6,49 %	+10,57 %	-0,42 %	+19,19 %	-17,72 %	-3,75 %	+12,46 %	+1,57 %	-5,34 %	-21,46 %	-6,16 %	-9,35 %	**-29,79 %**	**283,87 %**
2012	+0,57 %	+4,38 %	-13,92 %	-0,59 %	+36,11 %	-20,86 %	+5,22 %	-3,93 %	-4,73 %	-8,38 %	-8,44 %	+5,79 %	**-17,29 %**	**217,51 %**
2013	+9,44 %	+2,11 %	+3,62 %	+24,32 %	-14,69 %	-6,07 %	+1,18 %	-2,79 %	-4,77 %	+6,01 %	+1,84 %	+3,64 %	**+20,89 %**	**283,84 %**
2014	-4,93 %	+8,74 %	-5,74 %	-1,34 %	+3,49 %	-0,24 %	-2,92 %	+13,20 %	+4,16 %	-0,98 %	+16,56 %	-2,18 %	**+28,26 %**	**392,32 %**
2015	+8,85 %	+5,23 %	+3,02 %	-4,95 %	-0,11 %	-14,55 %	+11,09 %	-13,58 %	+1,51 %	+3,75 %	+11,98 %	-4,10 %	**+3,94 %**	**411,71 %**
2016	+1,58 %	+3,71 %	-2,78 %	-10,25 %	-4,41 %	+2,35 %	+6,55 %	-5,33 %	-2,87 %	-9,89 %	-3,21 %	-1,75 %	**-24,48 %**	**286,42 %**
2017	+0,94 %	+6,39 %	-0,19 %	+1,15 %	+2,89 %	-3,59 %	+7,65 %	+4,52 %	-0,64 %	+15,19 %	+1,76 %	+4,08 %	**+46,68 %**	**466,80 %**
2018	+11,18 %	-13,43 %	+2,61 %	-0,16 %	-3,35 %	-2,61 %	+1,33 %	-0,68 %	-5,97 %	-14,45 %	+1,73 %	+0,83 %	**-22,92 %**	**336,88 %**
2019	+5,53 %	+5,50 %	+4,39 %	+6,29 %	-5,02 %	+7,37 %	+2,56 %	+10,48 %	-6,23 %	-2,34 %	+4,12 %	+2,43 %	**+39,41 %**	**509,06 %**
2020	+7,99 %	+0,39 %	+4,75 %	+2,86 %	-1,31 %	-2,95 %	+8,10 %	-0,66 %	-8,08 %	-5,00 %	+0,53 %	+5,45 %	**+11,23 %**	**577,46 %**
2021	+1,58 %	+9,93 %	+1,87 %	+1,74 %	+6,42 %	-2,77 %	+3,98 %	+0,24 %	-0,98 %	+4,63 %	-9,17 %	+3,30 %	**+21,34 %**	**722,03 %**
2022	+1,82 %	+4,94 %	+3,56 %	+5,06 %	+0,03 %	-12,51 %	+2,16 %	-12,37 %	+2,18 %	-2,46 %	-6,85 %	-3,67 %	**-18,54 %**	**569,60 %**
2023	-8,18 %	+2,46 %	-20,54 %	-1,70 %	-0,45 %	+2,20 %	-2,10 %	-10,65 %	+1,90 %	-3,38 %	-0,72 %	+8,04 %	**-30,94 %**	**362,40 %**
2024	-4,69 %	+7,60 %	+11,73 %	-0,57 %	-6,26 %	+3,18 %	-6,59 %	-6,28 %	+1,61 %	-4,96 %	+1,88 %	-6,31 %	**-11,09 %**	**311,10 %**
2025	+1,39 %	-3,45 %	-4,92 %°										**-6,93 %**	**+282,60 %**

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

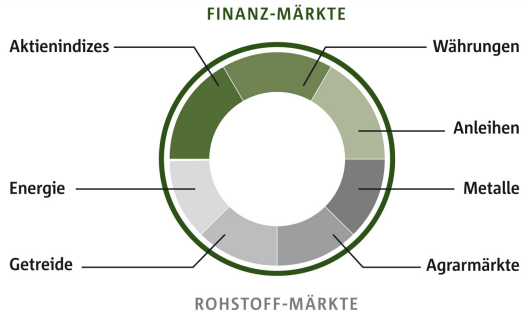
° vorläufiger Monatsendwert



logarithmische Darstellung

Quelle: Superfund; Zeitraum: 03.05.2001 - 31.03.2025

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein zuverlässiger Indikator für zukünftige Ergebnisse.



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

ERTRAGS *Kennzahlen*

Seit Handelsbeginn	282,60 %
Performance p.a.	5,77 %
Seit Jahresbeginn	-6,93 %
12-Monatsperformance	-27,78 %
Durchschnittl. Monatsperformance	0,47 %
Beste Monatsperformance	38,38 %

RISIKO *Kennzahlen*

Volatilität p.a.	38,77 %
Monatl. Standardabweichung	11,19 %
Max. Anfangsrisiko pro Position	2,00 %
Typical margin to equity	40 %
Max. Wertverlust	65,07 %
% positive Monate	53,31 %

STATISTIK *Kennzahlen*

Sharpe Ratio (3 Jahre) **	-1,14
Sharpe Ratio (5 Jahre) **	-0,54
Sharpe Ratio **	0,15
Volatilität (3 Jahre)	21,91 %
Volatilität (5 Jahre)	20,50 %
Sortino Ratio p.a. **	0,24
Sortino Ratio (1 Jahr) **	-4,16
Korrelation zu S&P500	-0,05
Korrelation zu Hang Seng	-0,08
Korrelation zu EURO STOXX 50	-0,09
Korrelation zu Managed Futures Index[2]	0,74
Korrelation zu Equity Market Neutral Index[3]	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:	NAV Fund Administration Group
Auditor:	BDO Cayman Islands
Rechtsbeistand:	Campbells
Homepage:	www.superfund.com

WERTENTWICKLUNG

der vergangenen 12 Monate	Superfund Green Master[1]	MSCI World
31.03.2020 - 31.03.2021	+11,42 %	+51,76 %
31.03.2021 - 31.03.2022	+18,03 %	+8,58 %
31.03.2022 - 31.03.2023	-44,98 %	-9,50 %
31.03.2023 - 29.03.2024	+5,85 %	+24,38 %
29.03.2024 - 31.03.2025	-27,78 %	+10,72 %

SUPERFUND INVEST BETTER

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