

Previamente: Superfund Cayman

## SUPERFUND GREEN MASTER<sup>1</sup> CERRÓ EL MES DE DICIEMBRE CON UN RENDIMIENTO DE 0,83 %

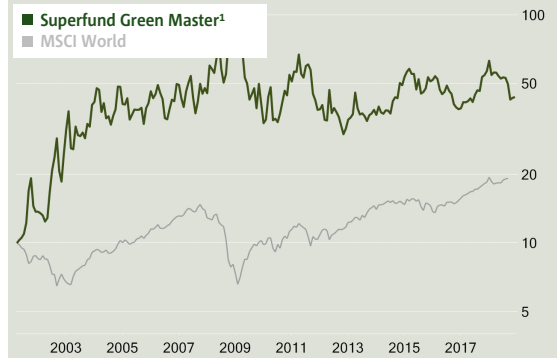
Superfund Green utiliza principalmente estrategias de tendencia de medio a largo plazo, y opera en aproximadamente 150 mercados financieros y de materias primas con gran liquidez en todo el mundo. Para una mayor diversificación, Superfund Green emplea también estrategias a corto plazo, como modelos de pronóstico, de contra-tendencia y de continuación de tendencia. Los objetivos de esta estrategia son lograr rendimientos altos, tanto en mercados alcistas como bajistas, y tener una volatilidad objetiva de aproximadamente 50% p.a. La estrategia de Superfund Green de futuros gestionados ha sido utilizada con éxito desde Marzo de 1996, y se basa en la propiedad de sistemas de trading automatizados, que eliminan eficazmente las emociones humanas. Los riesgos globales están permanentemente vigilados y cada posición es continuamente ajustada de acuerdo a la volatilidad del mercado. Debido a la baja correlación con otras clases de activos a largo plazo, Superfund Green es una valiosa adición a cualquier cartera.

Inicio: 03.05.2001, 10,00; Fecha: 31.12.2018, 43,69

	Ene	Feb	Mar	Abr	May	Jun	Jul	Ago	Sep	Oct	Nov	Dic	Acumulado	
<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>

Los resultados de performance son netos de gastos (excluyendo gastos de entrada e impuestos).

\* índice estimado de fin de mes



escala logarítmica

### ESTADÍSTICAS de RENTABILIDAD

Desde el inicio	336,90 %
Promedio anual	8,70 %
Rendimiento este año	-22,92 %
Tasa móvil del año	-22,92 %
Rendimiento mensual promedio	0,70 %
Mejor rendimiento mensual	38,38 %

### ESTADÍSTICAS de RIESGO

Desviación estándar anual	43,41 %
Desviación estándar mensual	12,53 %
Máximo riesgo inicial por posición	2,00 %
Typical margin to equity	40 %
Pérdida máxima	65,07 %
% de meses positivos	52,36 %

### ESTADÍSTICAS de EFICIENCIA

Ratio de Sharpe **	0,20
Ratio de Sharpe ** (1 año)	-0,94
Ratio de Sortino ** (anualizado)	0,34
Ratio de Sortino ** (1 año)	-1,21
Correlación con S&P500	-0,10
Correlación con EURO STOXX 50	-0,13
Correlación con Hang Seng	-0,09
Correlación con Managed Futures Index <sup>2</sup>	0,80
Correlación con Market Neutral Index <sup>3</sup>	0,15

\*\* modificado (rendimiento libre de riesgo = 0%)

2) CISDM CTA Equal Weighted Index

3) CISDM Equity Market Neutral Index

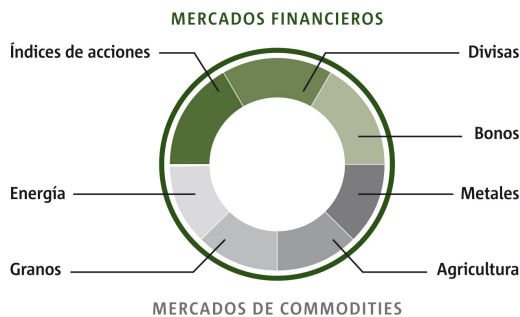
### Fund Facts

ISIN:	KYG8583R1011
Management fee:	1 % p.a.
Participación en los beneficios:	35 %
Rescate:	semanal
Trading Advisor:	Superfund Capital Management Inc., Grenada
Moneda:	USD
Banco Administrador:	Apex Fund Services (Malta) Ltd. Luxembourg Branch
Auditor:	BDO Cayman Islands
Asesor jurídico:	Campbells
Página web:	www.superfund.com

### PERFORMANCE

período: últimos 12 meses

	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 %



Representación esquemática. La diversificación real se ajusta continuamente a la situación del mercado actual.



1) Superfund Cayman Master Clase A, antiguamente denominado "Superfund Cayman" y en lo sucesivo denominado "Superfund Cayman". Superfund Cayman está cerrado a nuevas inversiones. No son posibles ni se aceptarán nuevas suscripciones o suscripciones adicionales. Los rendimientos que se incluyen en este documento están expresados netos de todos gastos. El desempeño pasado no es indicativo de resultados futuros. Los productos de Superfund constituyen inversiones especulativas. La posibilidad de pérdida total del capital invertido no puede excluirse. La información publicada en esta hoja informativa acerca de Superfund Cayman no constituye oferta de venta o solicitud de inversión de ningún tipo y su publicación se realiza a efectos informativos de los inversores existentes únicamente. El autor y los distribuidores de este material están expresamente exentos de cualquier responsabilidad por las inexactitudes que este documento pudiera contener y no serán considerados responsables por las mismas. Fuente: Superfund, Teletreder