

vormals: Superfund C Genussschein

SUPERFUND GREEN C GENUSSSCHEIN¹ BEENDETE DEN MONAT OKTOBER MIT EINER PERFORMANCE VON -3,14 %

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

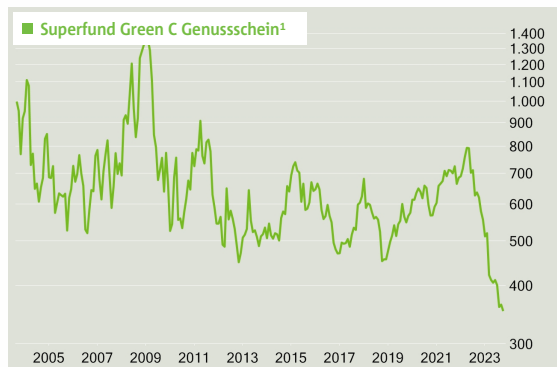
Handelsbeginn: 01.10.2003, NAV/Index: 1.000,00; Datum: 24.10.2023, NAV/Index: 353,00

| | Jan | Feb | Mär | Apr | Mai | Jun | Jul | Aug | Sep | Okt | Nov | Dez | |
|-------------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------------------|----------|----------|-----------------|
| 2003 | | | | | | | | | | -4,56 % | -19,35 % | +19,41 % | -8,09 % |
| 2004 | +3,61 % | +16,82 % | -2,80 % | -32,56 % | +5,84 % | -16,05 % | +2,66 % | -8,62 % | +7,30 % | +4,82 % | +21,52 % | +2,43 % | -7,42 % |
| 2005 | -19,37 % | -0,34 % | +6,09 % | -20,74 % | +4,94 % | +4,98 % | -0,86 % | -0,75 % | +1,47 % | -16,73 % | +17,62 % | +4,49 % | -23,94 % |
| 2006 | +12,22 % | -7,59 % | +3,88 % | +9,89 % | -8,72 % | -5,96 % | -19,52 % | -1,78 % | +12,24 % | +10,34 % | -0,56 % | +19,28 % | +17,99 % |
| 2007 | +2,92 % | -13,75 % | -9,32 % | +15,18 % | +8,50 % | +7,32 % | -15,97 % | -14,95 % | +11,24 % | +18,05 % | -9,86 % | +5,47 % | -3,67 % |
| 2008 | -5,89 % | +31,84 % | +2,33 % | -4,17 % | +15,68 % | +16,63 % | -20,07 % | -13,24 % | +9,81 % | +34,92 % | +3,36 % | +3,32 % | +80,12 % |
| 2009 | +1,35 % | +1,36 % | -5,35 % | -13,88 % | -23,65 % | -6,00 % | -15,00 % | +5,28 % | +6,10 % | -15,48 % | +21,26 % | -14,71 % | -50,12 % |
| 2010 | -20,48 % | +3,52 % | +26,13 % | +10,25 % | -26,61 % | +0,75 % | -4,71 % | +8,36 % | +6,71 % | +9,55 % | -4,38 % | +19,98 % | +17,21 % |
| 2011 | -6,40 % | +8,78 % | -0,66 % | +15,94 % | -16,06 % | -3,63 % | +11,13 % | +1,30 % | -5,70 % | -19,35 % | -6,19 % | -7,62 % | -29,61 % |
| 2012 | -0,02 % | +3,43 % | -12,95 % | -0,98 % | +33,62 % | -14,31 % | +4,44 % | -3,88 % | -4,94 % | -7,79 % | -8,13 % | +4,68 % | -13,63 % |
| 2013 | +7,96 % | +1,46 % | +2,86 % | +21,29 % | -14,04 % | -5,52 % | +0,87 % | -3,23 % | -4,45 % | +4,97 % | +1,10 % | +3,33 % | +13,50 % |
| 2014 | -5,15 % | +7,56 % | -5,71 % | -1,62 % | +2,72 % | -0,50 % | -3,06 % | +11,79 % | +3,34 % | -1,32 % | +14,98 % | -2,67 % | +19,60 % |
| 2015 | +8,40 % | +4,58 % | +2,03 % | -4,05 % | -1,04 % | -13,47 % | +9,42 % | -12,23 % | +0,63 % | +3,12 % | +10,59 % | -4,24 % | +0,30 % |
| 2016 | +0,82 % | +2,85 % | -2,86 % | -9,65 % | -4,44 % | +1,46 % | +5,73 % | -5,32 % | -3,17 % | -9,68 % | -3,22 % | -1,97 % | -26,70 % |
| 2017 | +0,11 % | +5,41 % | -0,54 % | +0,29 % | +2,06 % | -3,75 % | +6,13 % | +3,55 % | -1,07 % | +13,36 % | +0,97 % | +3,12 % | +32,69 % |
| 2018 | +9,22 % | -13,47 % | +2,22 % | -0,67 % | -3,68 % | -3,02 % | +0,79 % | -1,31 % | -5,87 % | -13,56 % | +0,89 % | -0,01 % | -26,81 % |
| 2019 | +4,45 % | +4,45 % | +3,26 % | +5,14 % | -5,21 % | +6,00 % | +1,75 % | +8,73 % | -6,13 % | -2,80 % | +3,27 % | +1,59 % | +26,05 % |
| 2020 | +6,72 % | -0,04 % | +3,47 % | +2,22 % | -1,60 % | -3,21 % | +6,46 % | -1,14 % | -8,19 % | -5,01 % | +0,10 % | +4,32 % | +3,00 % |
| 2021 | +1,94 % | +8,83 % | +1,16 % | +1,25 % | +5,21 % | -2,61 % | +3,10 % | -0,28 % | -1,34 % | +3,58 % | -8,38 % | +3,14 % | +15,58 % |
| 2022 | +0,73 % | +3,85 % | +5,94 % | +4,66 % | -0,18 % | -11,48 % | +1,26 % | -11,79 % | +1,52 % | -2,47 % | -6,68 % | -4,13 % | -18,92 % |
| 2023 | -7,87 % | +1,61 % | -18,77 % | -2,42 % | -1,33 % | +1,32 % | -2,52 % | -10,26 % | +1,16 % | -3,14 % [*] | | | -36,43 % |

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; Zeitraum: 01.10.2003 - 24.10.2023

ERTRAGS Kennzahlen

| | |
|----------------------------------|----------|
| Seit Handelsbeginn | -64,70 % |
| Performance p.a. | -5,05 % |
| Seit Jahresbeginn | -36,43 % |
| 12-Monatsperformance | -43,13 % |
| Durchschnittl. Monatsperformance | -0,43 % |
| Beste Monatsperformance | 34,92 % |

RISIKO Kennzahlen

| | |
|---------------------------------|---------|
| Volatilität p.a. | 34,37 % |
| Monatl. Standardabweichung | 9,92 % |
| Max. Anfangsrisiko pro Position | 2,00 % |
| Typical margin to equity | 40 % |
| Max. Wertverlust | 74,07 % |
| % positive Monate | 52,28 % |

STATISTIK Kennzahlen

| | |
|---|---------|
| Sharpe Ratio (3 Jahre) ** | -0,74 |
| Sharpe Ratio (5 Jahre) ** | -0,26 |
| Sharpe Ratio ** | -0,15 |
| Volatilität (3 Jahre) | 19,93 % |
| Volatilität (5 Jahre) | 18,54 % |
| Sortino Ratio p.a. ** | -0,22 |
| Sortino Ratio (1 Jahr) ** | -2,40 |
| Korrelation zu S&P500 | 0,07 |
| Korrelation zu Hang Seng | -0,01 |
| Korrelation zu EURO STOXX 50 | 0,06 |
| Korrelation zu Managed Futures Index ² | 0,73 |
| Korrelation zu Equity Market Neutral Index ³ | 0,19 |

** modifiziert (risikofreie Rendite = 0%)

2) CISDM CTA Equal Weighted Index

3) CISDM Equity Market Neutral Index

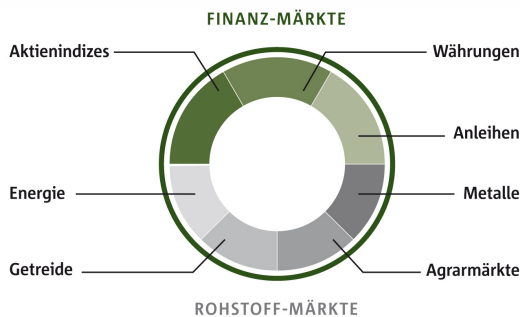
Fund Facts

| | |
|--------------------|---|
| ISIN: | AT0000641188 |
| Managementgebühr: | 0,4 % p.m. |
| Gewinnbeteiligung: | 30 % |
| Empf. Haltedauer: | mind. 6 Jahre |
| Kündigung: | monatlich |
| Währung: | EUR |
| Zahlstelle: | Liechtensteinische Landesbank (Österreich) AG |
| Auditor: | KPMG Austria |
| Trading Advisor: | Superfund Trading Management Inc. |
| Homepage: | www.superfund.com |

WERTENTWICKLUNG

der vergangenen 12-Monats-Perioden

| | |
|-------------------------|----------|
| 31.10.2018 - 31.10.2019 | +21,20 % |
| 31.10.2019 - 30.10.2020 | +3,47 % |
| 30.10.2020 - 29.10.2021 | +27,74 % |
| 29.10.2021 - 31.10.2022 | -14,37 % |
| 31.10.2022 - 24.10.2023 | -43,13 % |



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

1) Wichtiger Hinweis: Beim Superfund C handelt es sich um einen geschlossenen Fonds. Zeichnungen von Superfund C 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 C 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

