



## GET Capital Future long/short bis 31.05.2021

---

## Profil der Strategie

### Instrumente

- Hochliquide Future-Märkte global
- Kurzlaufende Staatsanleihen (Initial-Margin ca. 70-80% des Fondsvolumens)
- Kasse (Währungskonten für die Variation-Margin)

Einsatz von KI Returnschätzern (Mustererkennungsverfahren) über verschiedene Betrachtungszeiträume

- Kurzfristige Schätzer (BOCD)
- Mittelfristige Betrachtung (Wavelet)
- Zyklusbetrachtung (Hidden Markov Modelle)

Niedriger Drawdown durch Kombination von long/short und Kassepositionen

Systematische Überperformance zu Geldmarkt plus 400 BP

# Anlageuniversum

CAC 40 Total Return Indx

DAX TR

AEX TR

IBEX 35 TR

FTSE MIB TR

FTSE UK Series FTSE 100 TR(LocalCur)

OBX STOCK(LocalCur)

OMX STOCKHOLM 30 TR(LOC)

SMI TR(LocalCur)

SP ASX 200 TR(LOC)

TOPIX TR(LocalCur)

Hang Seng China Enterprises In(LocalCur)

Hang Seng Total Return(LocalCur)

NASDAQ 100 TOTAL RETURN(LocalCur)

Standard & Poors US 500 TR(LocalCur)

DJ Industrial Average TR(LocalCur)

MSCI Canada Local(LocalCur)

CAC 40 Total Return Indx Short

DAX TR Short

AEX TR Short

IBEX 35 TR Short

FTSE MIB TR Short

FTSE UK Series FTSE 100 TR(LocalCur) Short

OBX STOCK(LocalCur) Short

OMX STOCKHOLM 30 TR(LOC) Short

SMI TR(LocalCur) Short

SP ASX 200 TR(LOC) Short

TOPIX TR(LocalCur) Short

Hang Seng China Enterprises In(LocalCur) Short

Hang Seng Total Return(LocalCur) Short

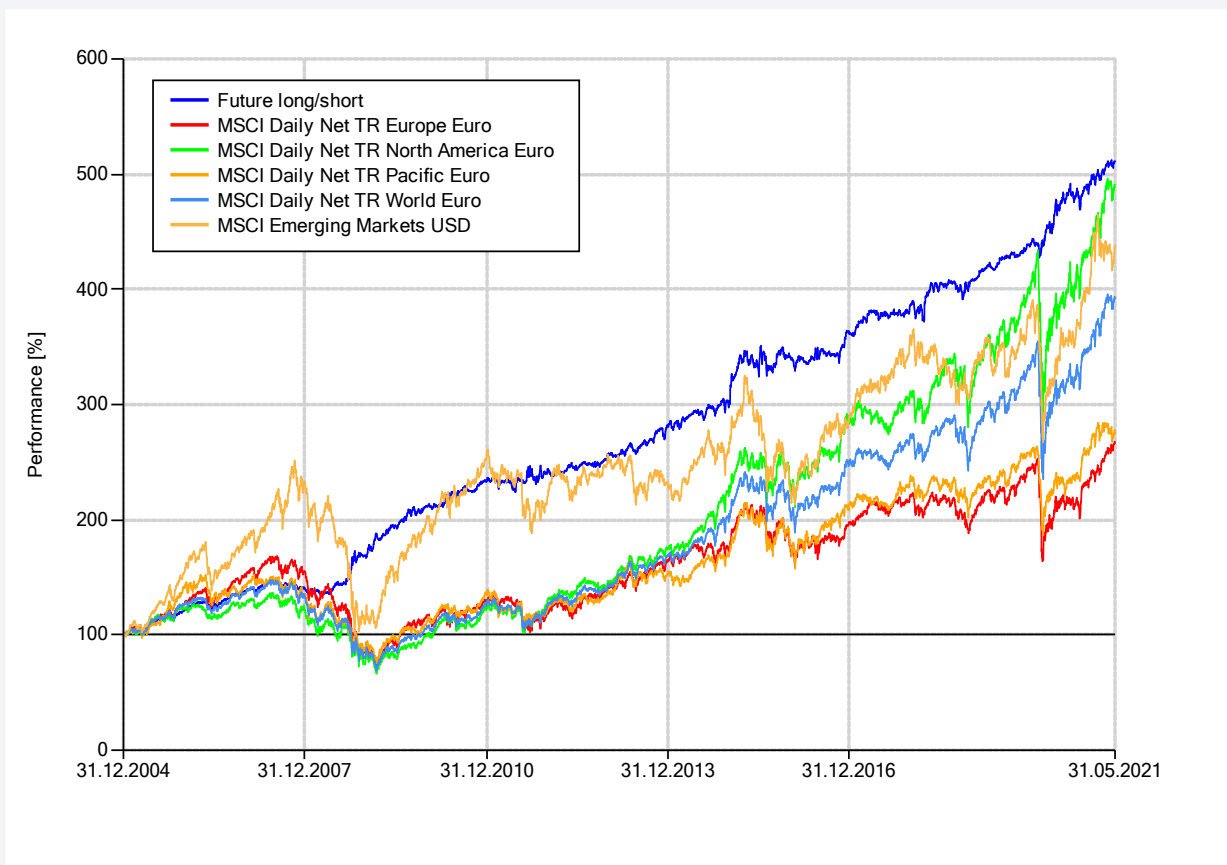
NASDAQ 100 TOTAL RETURN(LocalCur) Short

Standard & Poors US 500 TR(LocalCur) Short

DJ Industrial Average TR(LocalCur) Short

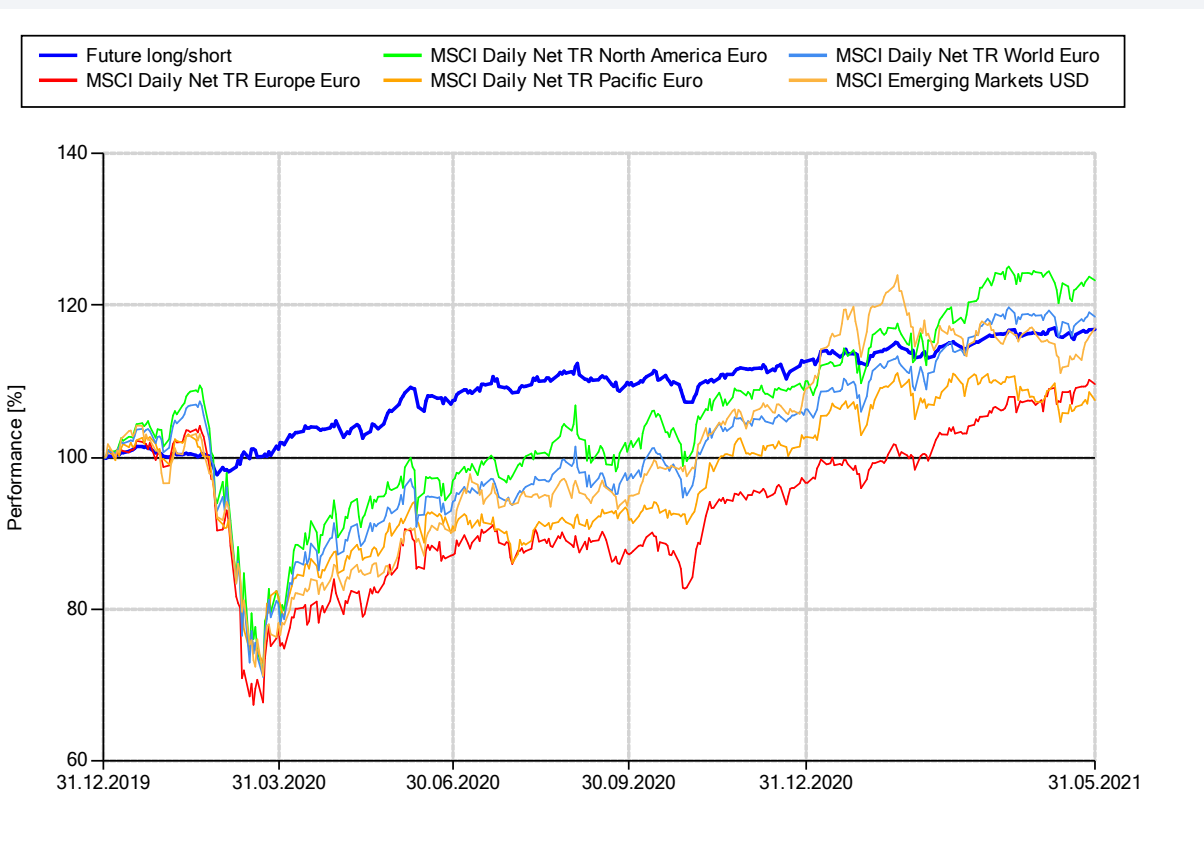
MSCI Canada Local(LocalCur) Short

# Performance 31.12.2004 - 31.05.2021



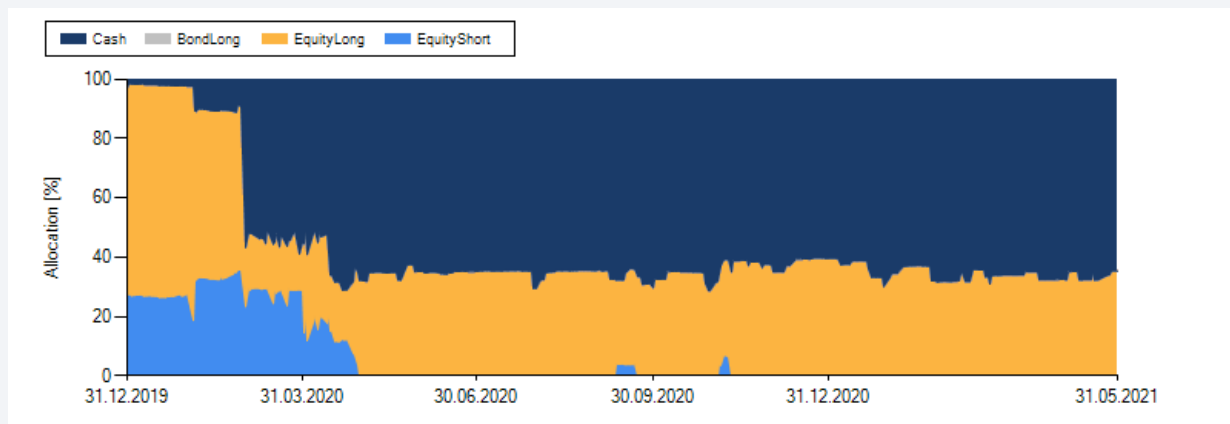
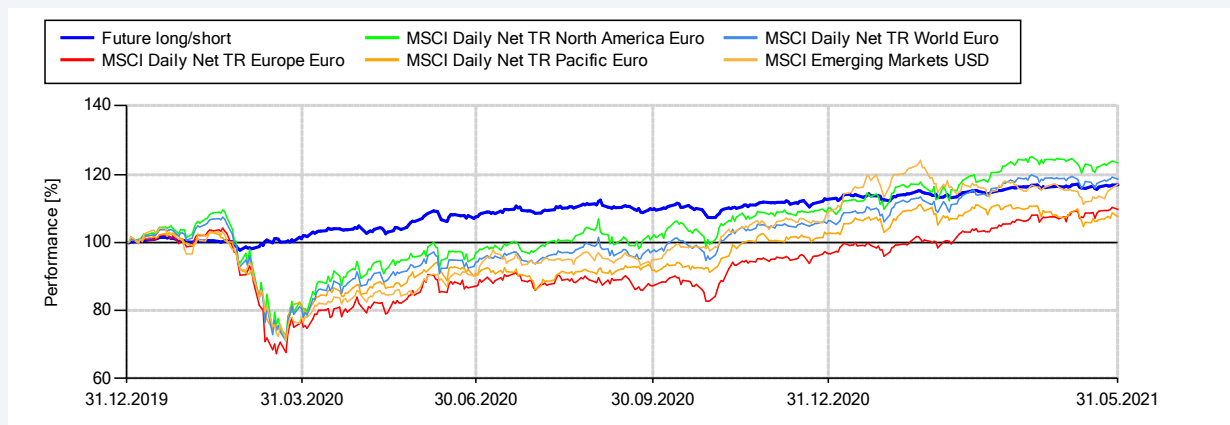
	Return p.a.	Drawdown
Future long/short	10.45%	-9.68%
MSCI Daily Net TR Europe Euro	6.15%	-58.54%
MSCI Daily Net TR North America Euro	10.15%	-51.46%
MSCI Daily Net TR Pacific Euro	6.36%	-50.30%
MSCI Daily Net TR World Euro	8.67%	-53.40%
MSCI Emerging Markets USD	9.42%	-60.01%

# Performance 31.12.2019 - 31.05.2021



	Return	Drawdown
Future long/short	16.85%	-4.56%
MSCI Daily Net TR Europe Euro	9.66%	-35.25%
MSCI Daily Net TR North America Euro	23.30%	-34.37%
MSCI Daily Net TR Pacific Euro	7.54%	-29.20%
MSCI Daily Net TR World Euro	18.52%	-33.76%
MSCI Emerging Markets USD	17.01%	-31.62%

# Performance 31.12.2019 - 31.05.2021



	Return	Drawdown
Future long/short	16.85%	-4.56%
MSCI Daily Net TR Europe Euro	9.66%	-35.25%
MSCI Daily Net TR North America Euro	23.30%	-34.37%
MSCI Daily Net TR Pacific Euro	7.54%	-29.20%
MSCI Daily Net TR World Euro	18.52%	-33.76%
MSCI Emerging Markets USD	17.01%	-31.62%

## Performance (Monthly) - 1 Jahr

	Future long/short	Euribor 1M+400
<b>Mai '21</b>	0.43%	0.29%
<b>Apr '21</b>	1.04%	0.28%
<b>Mrz '21</b>	1.81%	0.31%
<b>Feb '21</b>	0.59%	0.26%
<b>Jan '21</b>	-0.10%	0.27%
<b>Dez '20</b>	0.84%	0.29%
<b>Nov '20</b>	4.08%	0.29%
<b>Okt '20</b>	-2.11%	0.28%
<b>Sep '20</b>	-1.54%	0.28%
<b>Aug '20</b>	2.56%	0.29%
<b>Jul '20</b>	0.97%	0.29%
<b>Jun '20</b>	1.32%	0.30%

\* Stand: 31.05.2021

## Drawdown (Monthly) - 1 Jahr

	Future long/short
<b>Mai '21</b>	-1.30%
<b>Apr '21</b>	-0.96%
<b>Mrz '21</b>	-0.88%
<b>Feb '21</b>	-1.76%
<b>Jan '21</b>	-1.66%
<b>Dez '20</b>	-1.69%
<b>Nov '20</b>	-0.43%
<b>Okt '20</b>	-3.75%
<b>Sep '20</b>	-3.27%
<b>Aug '20</b>	-0.52%
<b>Jul '20</b>	-1.93%
<b>Jun '20</b>	-2.87%

\* Stand: 31.05.2021



## Bestände per 31.05.2021

Futures auf Aktienindex													
Name	ISIN	Land	Whg	Verfall	Kontrakt		Vereinb Kurs	Tages		Tageswert EUR	GuV	Underl %FV	GuV %FV
					Stück	Grösse		DevKurs	Kurs				
<b>Welt:</b>													
<b>long:</b>										<b>25.667.331</b>	<b>812.089</b>	<b>54,84</b>	<b>1,73</b>
SPI 200 Index Future (YAP) Juni 21	XC0005705469	AU	AUD	17.06.21	25	25,00	7.042,760	1,576	7.160,000	2.838.837	46.484	6,06	0,10
<b>SPI 200 Index Future (YAP) Juni 21</b>					25		7.042,760			<b>2.838.837</b>	<b>46.484</b>	<b>6,06</b>	<b>0,10</b>
Swiss Market Index Future (S30) Juni	CH0008616432	CH	CHF	18.06.21	26	10,00	10.675,000	1,098	11.414,000	2.702.707	174.987	5,77	0,37
<b>Swiss Market Index Future (S30) Juni 21</b>					26		10.675,000			<b>2.702.707</b>	<b>174.987</b>	<b>5,77</b>	<b>0,37</b>
IBEX 35 Future (MFXI) Juni 21	XC0009654556	ES	EUR	18.06.21	32	10,00	9.078,000		9.176,000	2.936.320	31.360	6,27	0,07
<b>IBEX 35 Future (MFXI) Juni 21</b>					32		9.078,000			<b>2.936.320</b>	<b>31.360</b>	<b>6,27</b>	<b>0,07</b>
FTSE 100 Index Future (FFI) Juni 21	XC0009658037	GB	GBP	18.06.21	35	10,00	6.924,157	0,860	7.004,000	2.850.846	32.499	6,09	0,07
<b>FTSE 100 Index Future (FFI) Juni 21</b>					35		6.924,157			<b>2.850.846</b>	<b>32.499</b>	<b>6,09</b>	<b>0,07</b>
FTSE MIB INDEX Future (IFS) Juni 21	XC000A0AE004	GB	EUR	18.06.21	22	5,00	24.160,000		25.245,000	2.776.950	119.350	5,93	0,25
<b>FTSE MIB INDEX Future (IFS) Juni 21</b>					22		24.160,000			<b>2.776.950</b>	<b>119.350</b>	<b>5,93</b>	<b>0,25</b>
AEX Future (AEX) Juni 21	XC0009690543	NL	EUR	18.06.21	20	200,00	698,500		712,900	2.851.600	57.600	6,09	0,12
<b>AEX Future (AEX) Juni 21</b>					20		698,500			<b>2.851.600</b>	<b>57.600</b>	<b>6,09</b>	<b>0,12</b>
OMX Index Future (O30) Juni 21	XC0009691236	SE	SEK	18.06.21	126	100,00	2.253,220	10,122	2.255,500	2.807.676	2.838	6,00	0,01
<b>OMX Index Future (O30) Juni 21</b>					126		2.253,220			<b>2.807.676</b>	<b>2.838</b>	<b>6,00</b>	<b>0,01</b>
Mini Sized DJIA Index Future (1YM) J	US12495D1081	US	USD	18.06.21	21	5,00	32.666,000	1,219	34.513,000	2.972.452	159.074	6,35	0,34
<b>Mini Sized DJIA Index Future (1YM) Juni</b>					21		32.666,000			<b>2.972.452</b>	<b>159.074</b>	<b>6,35</b>	<b>0,34</b>
E-Mini S&P 500 Index Future (ES) Jun	XC0009656890	US	USD	18.06.21	17	50,00	3.932,900	1,219	4.202,400	2.929.943	187.897	6,26	0,40
<b>E-Mini S&amp;P 500 Index Future (ES) Juni 2</b>					17		3.932,900			<b>2.929.943</b>	<b>187.897</b>	<b>6,26</b>	<b>0,40</b>
<b>Welt:</b>										<b>25.667.331</b>	<b>812.089</b>	<b>54,84</b>	<b>1,73</b>
<b>Futures auf Aktienindex Gesamt</b>										<b>25.667.331</b>	<b>812.089</b>	<b>54,84</b>	<b>1,73</b>

# Kontakt



**Harald Schnorrenberg**  
 CEO/ Partner  
 Tel: +49 (0)2161 307 35 22  
 E-Mail: schnorrenberg@get-capital.de



**Marco Wunderlich**  
 Head of Institutional Sales  
 Tel: +49 (0)2161 307 35 12  
 E-Mail: wunderlich@get-capital.de

**GET Capital AG**  
 Heinz-Nixdorf-Str. 31  
 41179 Mönchengladbach  
 Germany



## Hinweis

Dieses Material ist ausschließlich für Ihren persönlichen Gebrauch und rein zu Informationszwecken erstellt worden. Jede Form der Kenntnisnahme, Veröffentlichung, Vervielfältigung oder Weitergabe des Inhalts an Dritte ist unzulässig, es sei denn wir haben zuvor zugestimmt.

Die in der Präsentation enthaltenen Angaben und Mitteilungen sind nicht als rechtlicher oder steuerlicher Rat zu verstehen. Sie dienen ausschließlich der allgemeinen Information. Diese Präsentation ersetzt nicht eine individuelle Anleger- und anlagegerechte Beratung.

Die hierin enthaltenen Einschätzungen entsprechen unserer nach bestem Wissen angestellten Beurteilung zum jetzigen Zeitpunkt, können sich jedoch – ohne Mitteilung hierüber – ändern. Wir haften nicht für die Vollständigkeit, die Zuverlässigkeit und die Genauigkeit des Materials wie aller sonstigen Informationen, die dem Empfänger schriftlich, mündlich oder in sonstiger Weise übermittelt oder zugänglich gemacht werden, soweit dies nicht unmittelbar durch unser eigenes vorsätzliches Fehlverhalten oder grobe Fahrlässigkeit verursacht wurde. Die Richtigkeit der Daten, die aufgrund veröffentlichter Informationen in diese Präsentation übernommen wurden, wird vorausgesetzt und nicht überprüft. Der Inhalt dieser Präsentation ist nicht rechtsverbindlich, es sei denn, wir erklären schriftlich und ausdrücklich etwas Anderes. Etwaig bestehende vertragliche Regelungen oder sonstige Abreden gelten auch im Rahmen dieser Präsentation einschließlich sämtlicher Aussagen im Zusammenhang mit dieser Präsentation sofern diese Regelungen anwendbar sind.

Angaben zur bisherigen Entwicklung erlauben keine Prognose für die Zukunft. Es ist nicht sicher, dass ein Portfolio die dargestellten Gewinne oder Verluste erzielt oder dass ein Portfolio denselben Grad an Genauigkeit früherer Projektionen erreichen wird.