



GET Capital Future long/short bis 30.06.2021

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

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

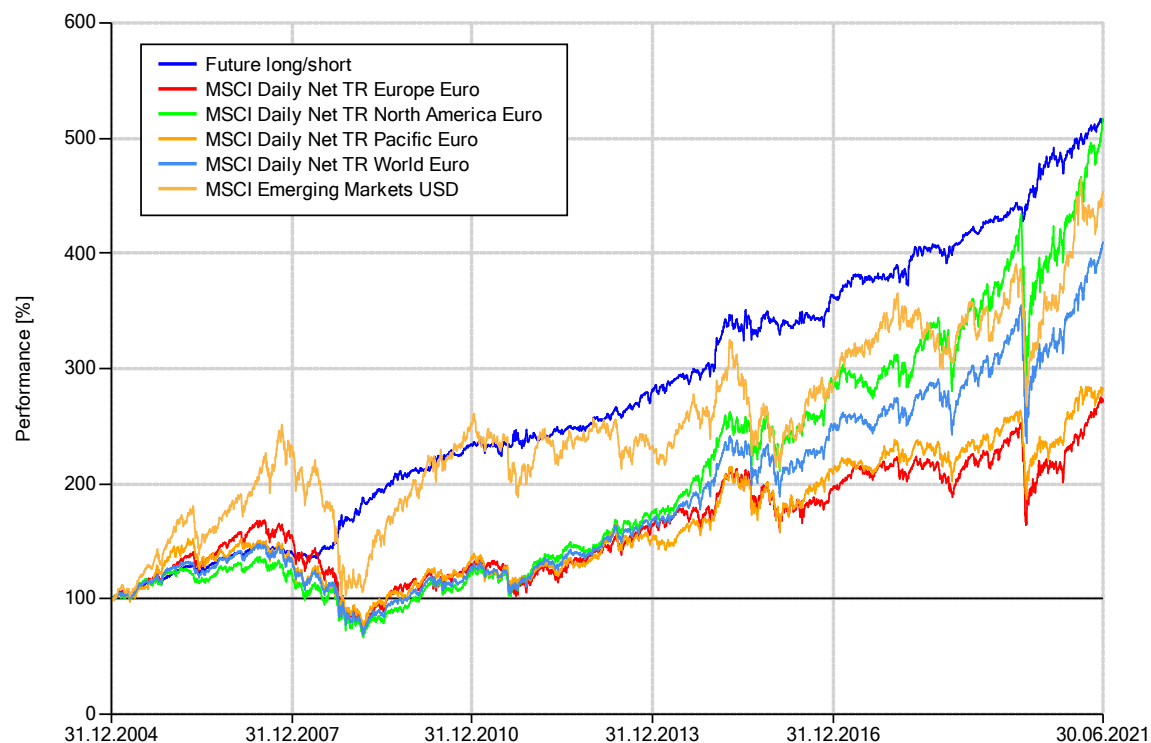
NASDAQ 100 TOTAL RETURN(LocalCur) Short

Standard & Poors US 500 TR(LocalCur) Short

DJ Industrial Average TR(LocalCur) Short

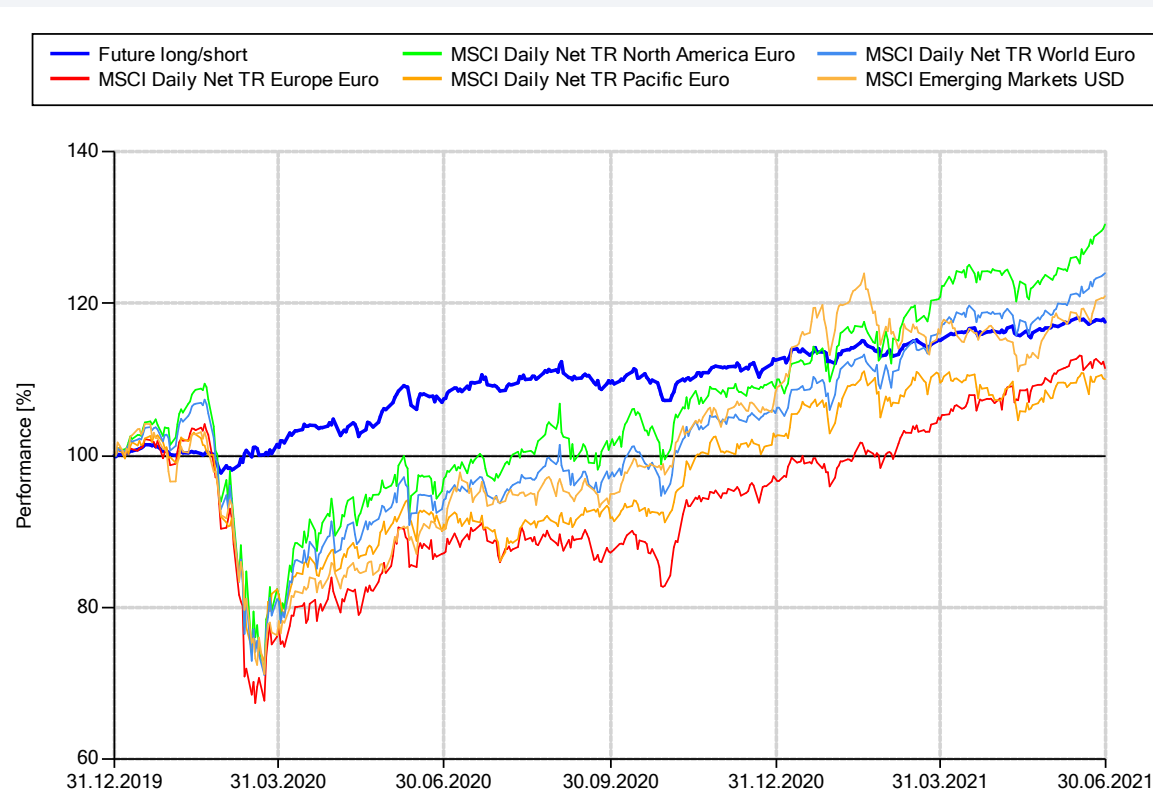
MSCI Canada Local(LocalCur) Short

Performance 31.12.2004 - 30.06.2021



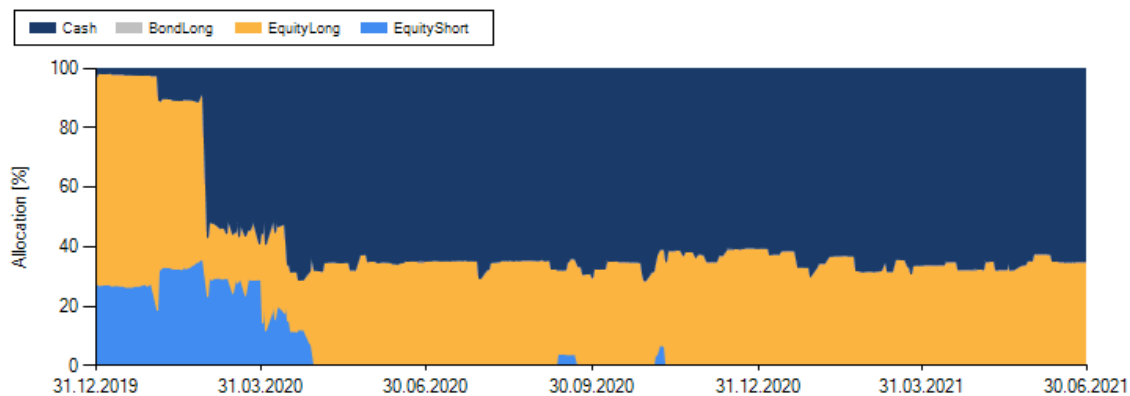
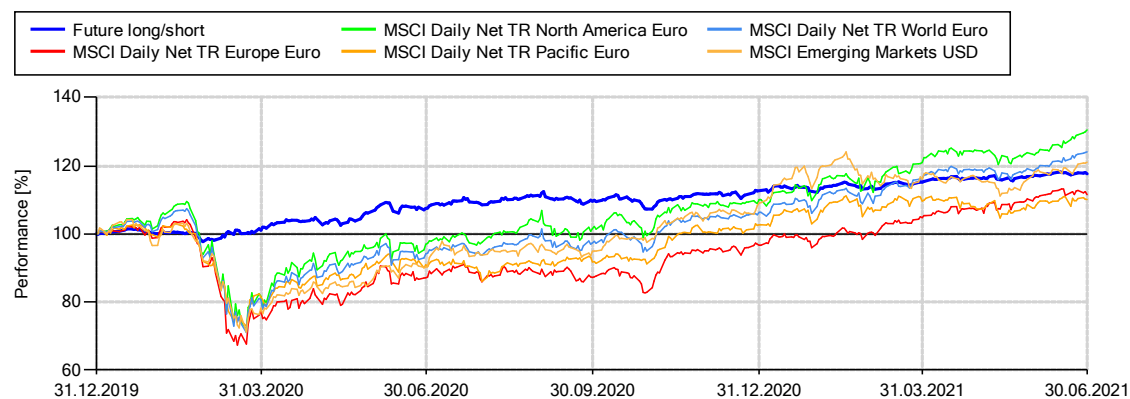
	Return p.a.	Drawdown
Future long/short	10.44%	-9.68%
MSCI Daily Net TR Europe Euro	6.22%	-58.54%
MSCI Daily Net TR North America Euro	10.47%	-51.46%
MSCI Daily Net TR Pacific Euro	6.47%	-50.30%
MSCI Daily Net TR World Euro	8.92%	-53.40%
MSCI Emerging Markets USD	9.59%	-60.01%

Performance 31.12.2019 - 30.06.2021



	Return	Drawdown
Future long/short	17.61%	-4.56%
MSCI Daily Net TR Europe Euro	11.52%	-35.25%
MSCI Daily Net TR North America Euro	30.45%	-34.37%
MSCI Daily Net TR Pacific Euro	10.07%	-29.20%
MSCI Daily Net TR World Euro	24.02%	-33.76%
MSCI Emerging Markets USD	21.01%	-31.62%

Performance 31.12.2019 - 30.06.2021



	Return	Drawdown
Future long/short	17.61%	-4.56%
MSCI Daily Net TR Europe Euro	11.52%	-35.25%
MSCI Daily Net TR North America Euro	30.45%	-34.37%
MSCI Daily Net TR Pacific Euro	10.07%	-29.20%
MSCI Daily Net TR World Euro	24.02%	-33.76%
MSCI Emerging Markets USD	21.01%	-31.62%

Performance (Monthly) - 1 Jahr

	Future long/short	Euribor 1M+400
Jun '21	0.65%	0.28%
Mai '21	0.43%	0.29%
Apr '21	1.04%	0.28%
Mrz '21	1.81%	0.31%
Feb '21	0.59%	0.26%
Jan '21	-0.10%	0.27%
Dez '20	0.84%	0.29%
Nov '20	4.08%	0.29%
Okt '20	-2.11%	0.28%
Sep '20	-1.54%	0.28%
Aug '20	2.56%	0.29%
Jul '20	0.97%	0.29%

* Stand: 30.06.2021

Drawdown (Monthly) - 1 Jahr

	Future long/short
Jun '21	-0.74%
Mai '21	-1.30%
Apr '21	-0.96%
Mrz '21	-0.88%
Feb '21	-1.76%
Jan '21	-1.66%
Dez '20	-1.69%
Nov '20	-0.43%
Okt '20	-3.75%
Sep '20	-3.27%
Aug '20	-0.52%
Jul '20	-1.93%

* Stand: 30.06.2021

Bestände per 30.06.2021

Futures auf Aktienindex

Name	ISIN	Land	Whg	Verfall	Kontrakt		Vereinb Kurs	Tages		Tageswert	GuV	Underl %FV	GuV %FV	
					Stück	Grösse		DevKurs	Kurs					EUR
Welt:														
long:											25.740.161	-88.108	54,23	-0,19
SPI 200 Index Future (YAP) Sep. 21	XC0005705469	AU	AUD	16.09.21	25	25,00	7.258,000	1,583	7.200,000	2.842.776	-22.900	5,99	-0,05	
SPI 200 Index Future (YAP) Sep. 21					25		7.258,000			2.842.776	-22.900	5,99	-0,05	
Swiss Market Index Future (S30) Sep.	CH0008616432	CH	CHF	17.09.21	26	10,00	11.825,000	1,097	11.940,000	2.829.397	27.251	5,96	0,06	
Swiss Market Index Future (S30) Sep. 21					26		11.825,000			2.829.397	27.251	5,96	0,06	
DAX-Index Future (FDAX) Sep. 21	DE0008469594	DE	EUR	17.09.21	7	25,00	15.737,571		15.487,000	2.710.225	-43.850	5,71	-0,09	
DAX-Index Future (FDAX) Sep. 21					7		15.737,571			2.710.225	-43.850	5,71	-0,09	
IBEX 35 Future (MFXI) Juli 21	XC0009654556	ES	EUR	16.07.21	32	10,00	9.168,500		8.755,000	2.801.600	-132.320	5,90	-0,28	
IBEX 35 Future (MFXI) Juli 21					32		9.168,500			2.801.600	-132.320	5,90	-0,28	
FTSE 100 Index Future (FFI) Sep. 21	XC0009658037	GB	GBP	17.09.21	35	10,00	7.070,500	0,860	6.971,000	2.835.914	-40.478	5,97	-0,09	
FTSE 100 Index Future (FFI) Sep. 21					35		7.070,500			2.835.914	-40.478	5,97	-0,09	
AEX Future (AEX) Juli 21	XC0009690543	NL	EUR	16.07.21	20	200,00	728,750		729,250	2.917.000	2.000	6,15	0,00	
AEX Future (AEX) Juli 21					20		728,750			2.917.000	2.000	6,15	0,00	
OMX Index Future (O30) Juli 21	XC0009691236	SE	SEK	16.07.21	126	100,00	2.278,000	10,125	2.256,750	2.808.358	-26.444	5,92	-0,06	
OMX Index Future (O30) Juli 21					126		2.278,000			2.808.358	-26.444	5,92	-0,06	
E-Mini S&P 500 Index Future (ES) Se	XC0009656890	US	USD	17.09.21	17	50,00	4.236,650	1,190	4.282,000	3.058.186	32.389	6,44	0,07	
E-Mini S&P 500 Index Future (ES) Sep. 2					17		4.236,650			3.058.186	32.389	6,44	0,07	
E-Mini NASDAQ-100 Index Future (N	XC0009665289	US	USD	17.09.21	12	20,00	13.986,550	1,190	14.563,000	2.936.705	116.244	6,19	0,24	
E-Mini NASDAQ-100 Index Future (NQ)					12		13.986,550			2.936.705	116.244	6,19	0,24	
Welt:											25.740.161	-88.108	54,23	-0,19
Futures auf Aktienindex Gesamt											25.740.161	-88.108	54,23	-0,19

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.