



Future long/short bis 31.08.2021

# Leistungsübersicht laufendes Jahr

Ergebnisse ytd. per 31.08.2021

## Futures long/short

Return **+ 5,9%**

Volatilität 5,9%

Drawdown **- 1,8%**

## Globale Aktien

Return **+ 21,1%**

Volatilität 12,6%

Drawdown **- 4,2%**

## Multi Asset ESG

Return **+ 11,8%**

Volatilität 10,1%

Drawdown **- 3,8%**

# Attraktive Rendite-Risiko-Profile, ... auch in negativen Marktphasen

Ergebnisse 2020

## Futures long/short

Return + **12,6%**

Volatilität 7,9%

Drawdown **- 4,6%**

## Globale Aktien

Return + **8,1%**

Volatilität 16,9%

Drawdown - 18,4%

## Multi Asset ESG

Return + **12,8%**

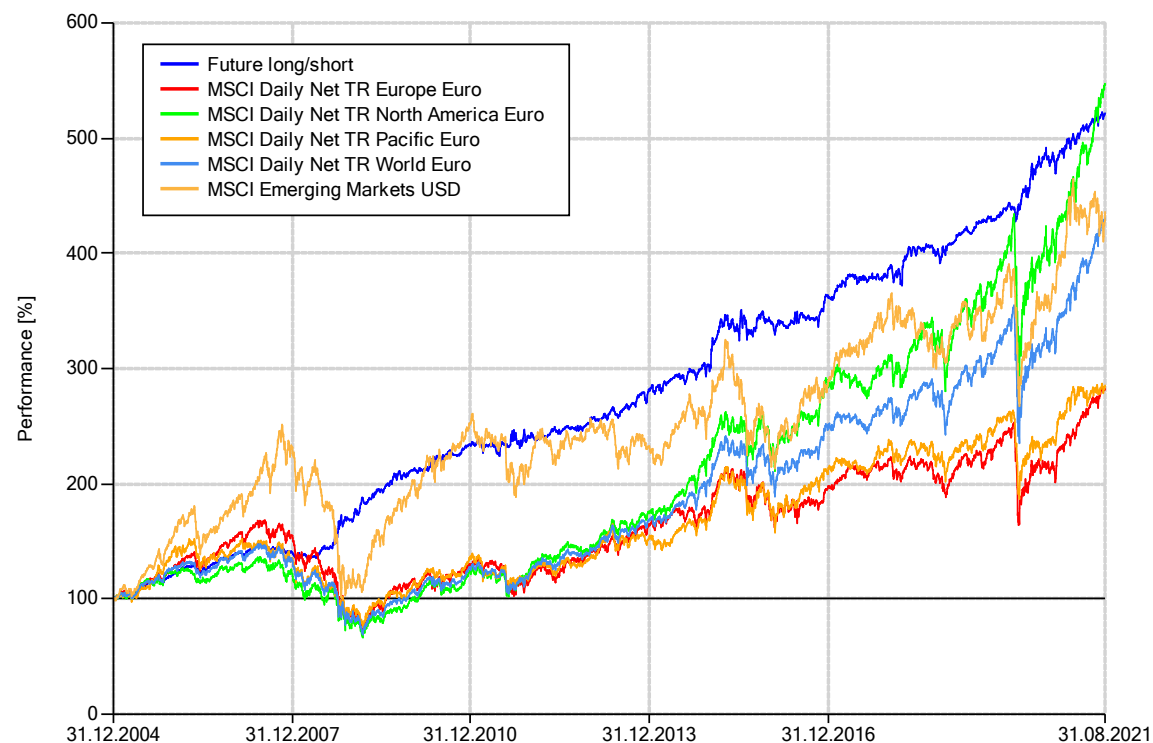
Volatilität 13,9%

Drawdown - 15,7%

## Profil der Strategie Future long/short

- **Niedriger Drawdown durch Kombination von long/short und Kassepositionen**
- **Systematische Überperformance zu Geldmarkt plus 400 BP**
- **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)

## Performance 31.12.2004 - 31.08.2021



|                                      | Return p.a. | Drawdown |
|--------------------------------------|-------------|----------|
| Future long/short                    | 10.42%      | -9.68%   |
| MSCI Daily Net TR Europe Euro        | 6.40%       | -58.54%  |
| MSCI Daily Net TR North America Euro | 10.72%      | -51.46%  |
| MSCI Daily Net TR Pacific Euro       | 6.49%       | -50.30%  |
| MSCI Daily Net TR World Euro         | 9.13%       | -53.40%  |
| MSCI Emerging Markets USD            | 9.23%       | -60.01%  |

# 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

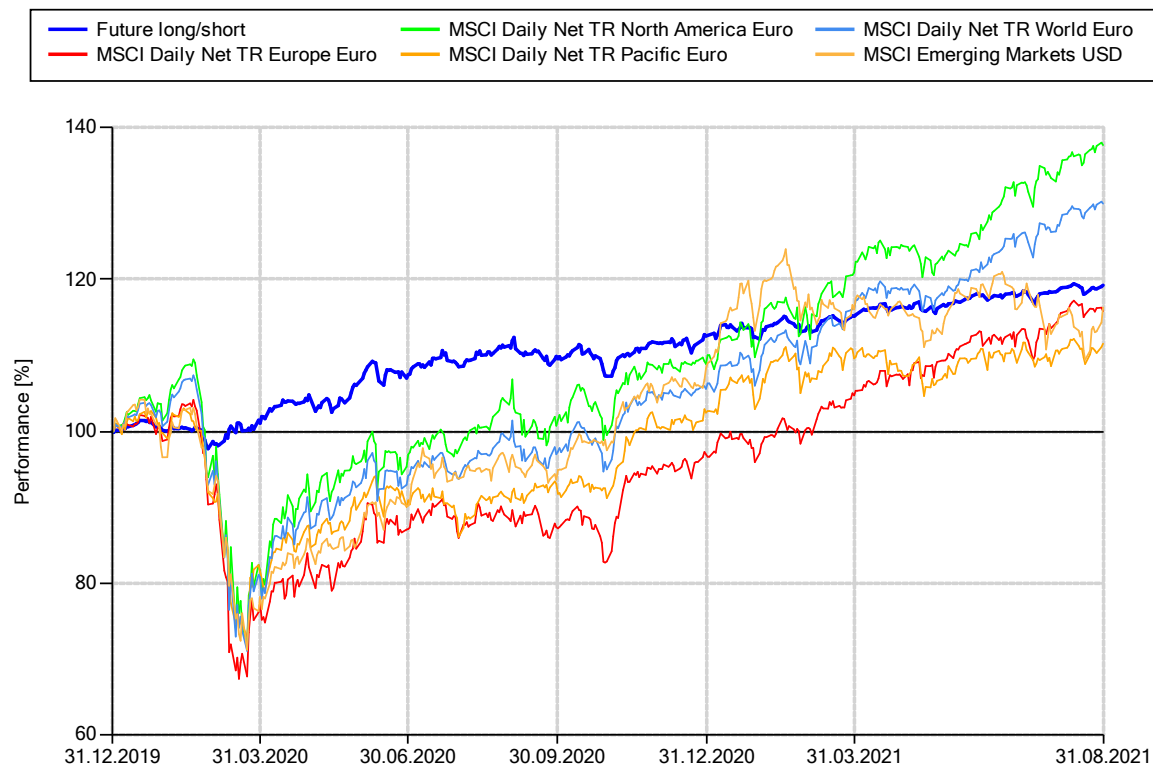
NASDAQ 100 TOTAL RETURN(LocalCur) Short

Standard & Poors US 500 TR(LocalCur) Short

DJ Industrial Average TR(LocalCur) Short

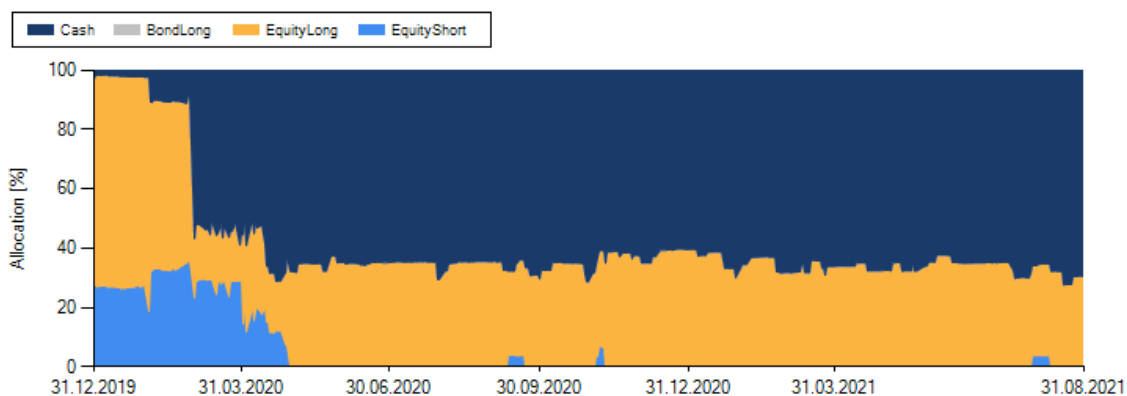
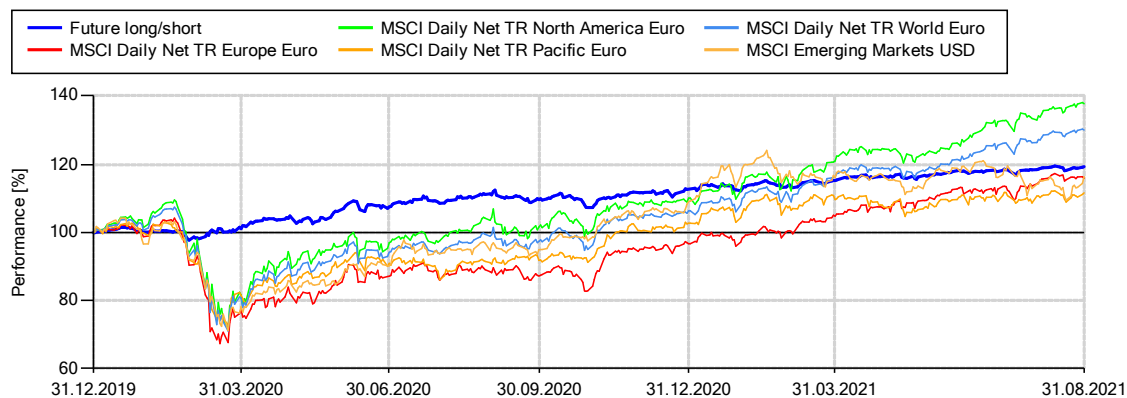
MSCI Canada Local(LocalCur) Short

## Performance 31.12.2019 - 31.08.2021



|                                      | Return | Drawdown |
|--------------------------------------|--------|----------|
| Future long/short                    | 19.24% | -4.56%   |
| MSCI Daily Net TR Europe Euro        | 15.83% | -35.25%  |
| MSCI Daily Net TR North America Euro | 37.69% | -34.37%  |
| MSCI Daily Net TR Pacific Euro       | 11.57% | -29.20%  |
| MSCI Daily Net TR World Euro         | 29.98% | -33.76%  |
| MSCI Emerging Markets USD            | 16.34% | -31.62%  |

## Performance 31.12.2019 - 31.08.2021



|                                      | Return | Drawdown |
|--------------------------------------|--------|----------|
| Future long/short                    | 19.24% | -4.56%   |
| MSCI Daily Net TR Europe Euro        | 15.83% | -35.25%  |
| MSCI Daily Net TR North America Euro | 37.69% | -34.37%  |
| MSCI Daily Net TR Pacific Euro       | 11.57% | -29.20%  |
| MSCI Daily Net TR World Euro         | 29.98% | -33.76%  |
| MSCI Emerging Markets USD            | 16.34% | -31.62%  |



## Performance und max. Drawdown - monatlich 1 Jahr

|                | Performance | Euribor 1M+400 |
|----------------|-------------|----------------|
| <b>Aug '21</b> | 0.78%       | 0.30%          |
| <b>Jul '21</b> | 0.60%       | 0.28%          |
| <b>Jun '21</b> | 0.65%       | 0.28%          |
| <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%          |

| Max. Drawdown |
|---------------|
| -1.16%        |
| -1.51%        |
| -0.74%        |
| -1.30%        |
| -0.96%        |
| -0.88%        |
| -1.76%        |
| -1.66%        |
| -1.69%        |
| -0.43%        |
| -3.75%        |
| -3.27%        |

\* Stand: 31.08.2021

## Bestände per 31.08.2021

| Futures auf Aktienindex                 |              |      |     |          |          |        |                 |         |            |                  |            |               |            |      |
|-----------------------------------------|--------------|------|-----|----------|----------|--------|-----------------|---------|------------|------------------|------------|---------------|------------|------|
| Name                                    | ISIN         | Land | Whg | Verfall  | Kontrakt |        | Vereinb<br>Kurs | Tages   |            | Tageswert<br>EUR | GuV        | Underl<br>%FV | GuV<br>%FV |      |
|                                         |              |      |     |          | Stück    | Grösse |                 | DevKurs | Kurs       |                  |            |               |            |      |
| Welt:                                   |              |      |     |          |          |        |                 |         |            |                  | 21.036.964 | 719.591       | 43,74      | 1,50 |
| long:                                   |              |      |     |          |          |        |                 |         |            |                  |            |               |            |      |
| SPI 200 Index Future (YAP) Sep. 21      | XC0005705469 | AU   | AUD | 16.09.21 | 12       | 25,00  | 7.423,000       | 1,614   | 7.470,000  | 1.388.747        | 8.738      | 2,89          | 0,02       |      |
| SPI 200 Index Future (YAP) Sep. 21      |              |      |     |          | 12       |        | 7.423,000       |         |            | 1.388.747        | 8.738      | 2,89          | 0,02       |      |
| Swiss Market Index Future (S30) Sep.    | CH0008616432 | CH   | CHF | 17.09.21 | 26       | 10,00  | 11.825,000      | 1,083   | 12.449,000 | 2.989.535        | 149.849    | 6,22          | 0,31       |      |
| Swiss Market Index Future (S30) Sep. 21 |              |      |     |          | 26       |        | 11.825,000      |         |            | 2.989.535        | 149.849    | 6,22          | 0,31       |      |
| DAX-Index Future (FDAX) Sep. 21         | DE0008469594 | DE   | EUR | 17.09.21 | 3        | 25,00  | 15.895,000      |         | 15.975,000 | 1.198.125        | 6.000      | 2,49          | 0,01       |      |
| DAX-Index Future (FDAX) Sep. 21         |              |      |     |          | 3        |        | 15.895,000      |         |            | 1.198.125        | 6.000      | 2,49          | 0,01       |      |
| CAC 40-Index Future (FCE) Sep. 21       | XC0009654440 | FR   | EUR | 17.09.21 | 44       | 10,00  | 6.825,500       |         | 6.693,000  | 2.944.920        | -58.300    | 6,12          | -0,12      |      |
| CAC 40-Index Future (FCE) Sep. 21       |              |      |     |          | 44       |        | 6.825,500       |         |            | 2.944.920        | -58.300    | 6,12          | -0,12      |      |
| AEX Future (AEX) Sep. 21                | XC0009690543 | NL   | EUR | 17.09.21 | 20       | 200,00 | 768,350         |         | 789,800    | 3.159.200        | 85.800     | 6,57          | 0,18       |      |
| AEX Future (AEX) Sep. 21                |              |      |     |          | 20       |        | 768,350         |         |            | 3.159.200        | 85.800     | 6,57          | 0,18       |      |
| OMX Index Future (O30) Sep. 21          | XC0009691236 | SE   | SEK | 17.09.21 | 126      | 100,00 | 2.376,950       | 10,166  | 2.371,500  | 2.939.341        | -6.755     | 6,11          | -0,01      |      |
| OMX Index Future (O30) Sep. 21          |              |      |     |          | 126      |        | 2.376,950       |         |            | 2.939.341        | -6.755     | 6,11          | -0,01      |      |
| E-Mini S&P 500 Index Future (ES) Se     | XC0009656890 | US   | USD | 17.09.21 | 17       | 50,00  | 4.236,650       | 1,183   | 4.525,200  | 3.252.099        | 207.371    | 6,76          | 0,43       |      |
| E-Mini S&P 500 Index Future (ES) Sep. 2 |              |      |     |          | 17       |        | 4.236,650       |         |            | 3.252.099        | 207.371    | 6,76          | 0,43       |      |
| E-Mini NASDAQ-100 Index Future (N       | XC0009665289 | US   | USD | 17.09.21 | 12       | 20,00  | 13.986,550      | 1,183   | 15.597,500 | 3.164.997        | 326.889    | 6,58          | 0,68       |      |
| E-Mini NASDAQ-100 Index Future (NQ)     |              |      |     |          | 12       |        | 13.986,550      |         |            | 3.164.997        | 326.889    | 6,58          | 0,68       |      |
| Welt:                                   |              |      |     |          |          |        |                 |         |            |                  | 21.036.964 | 719.591       | 43,74      | 1,50 |
| Futures auf Aktienindex Gesamt          |              |      |     |          |          |        |                 |         |            |                  | 21.036.964 | 719.591       | 43,74      | 1,50 |

# Kontaktdaten



**Harald Schnorrenberg**

CEO/ Partner

Tel: +49 (0)2161 307 35 22

E-Mail: [schnorrenberg@get-capital.de](mailto:schnorrenberg@get-capital.de)



**Marco Wunderlich**

Head of Institutional Sales

Tel: +49 (0)2161 307 35 12

E-Mail: [wunderlich@get-capital.de](mailto: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.