



GET Capital Future long/short bis 30.09.2021

Profil der Strategie

Instrumente

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

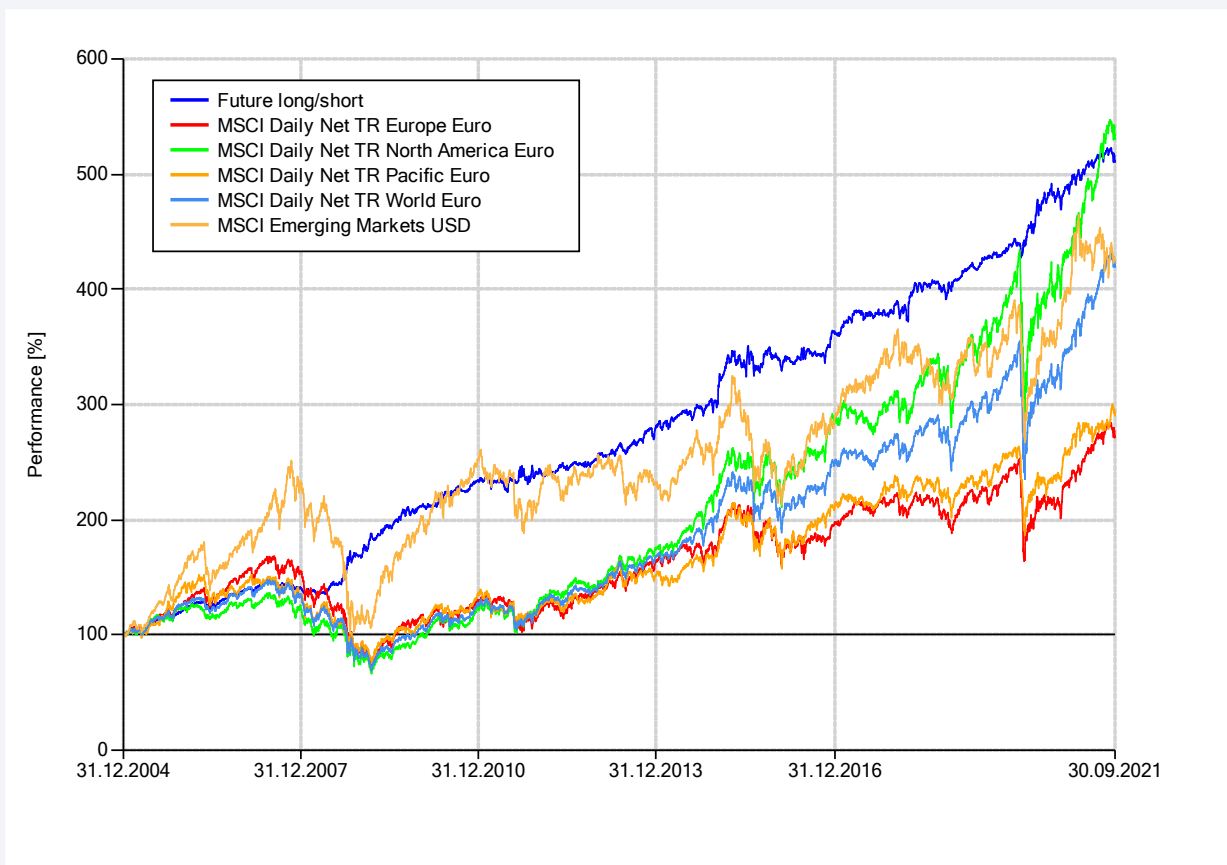
Einsatz von KI Returnschätzern (Mustererkennungsverfahren) über verschiedene Betrachtungszeiträume

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

Niedriger Drawdown durch Kombination von long/short und Kassepositionen

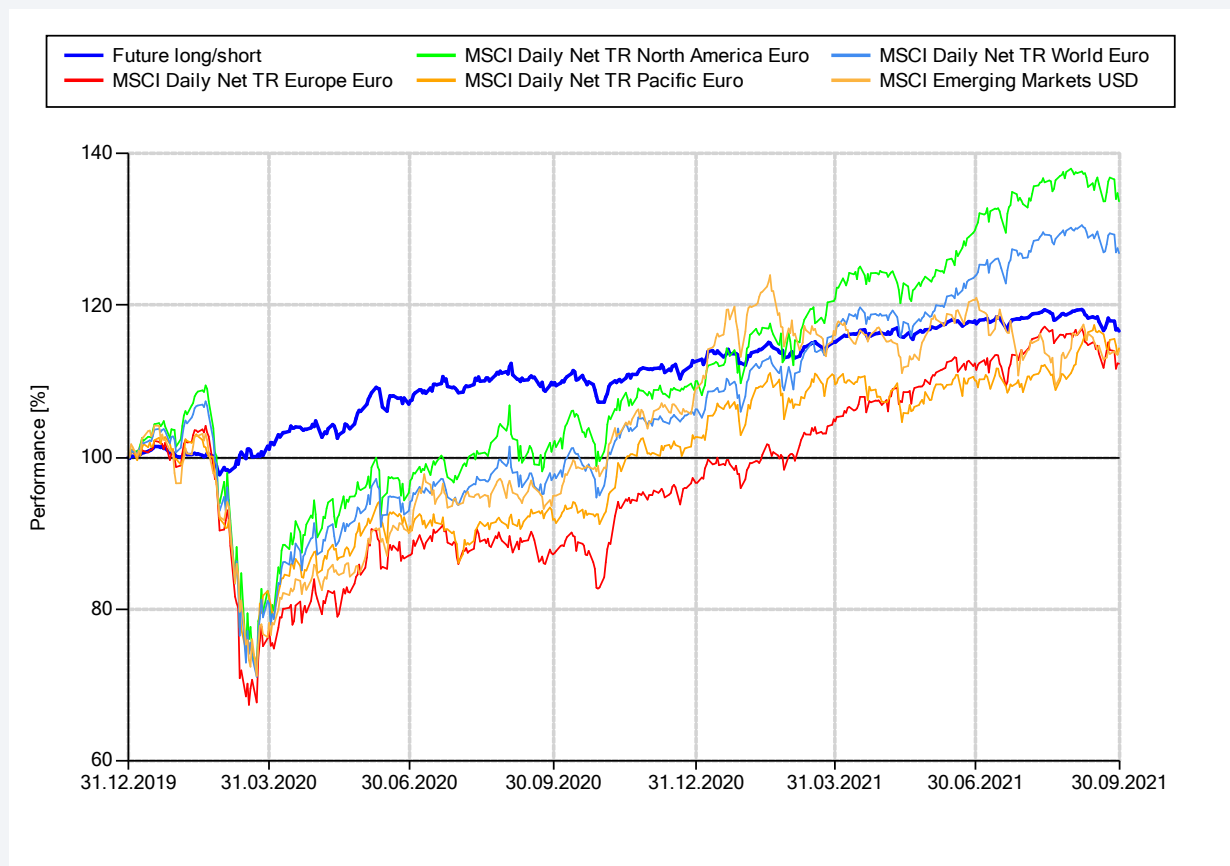
Systematische Überperformance zu Geldmarkt plus 400 BP

Performance 31.12.2004 - 30.09.2021



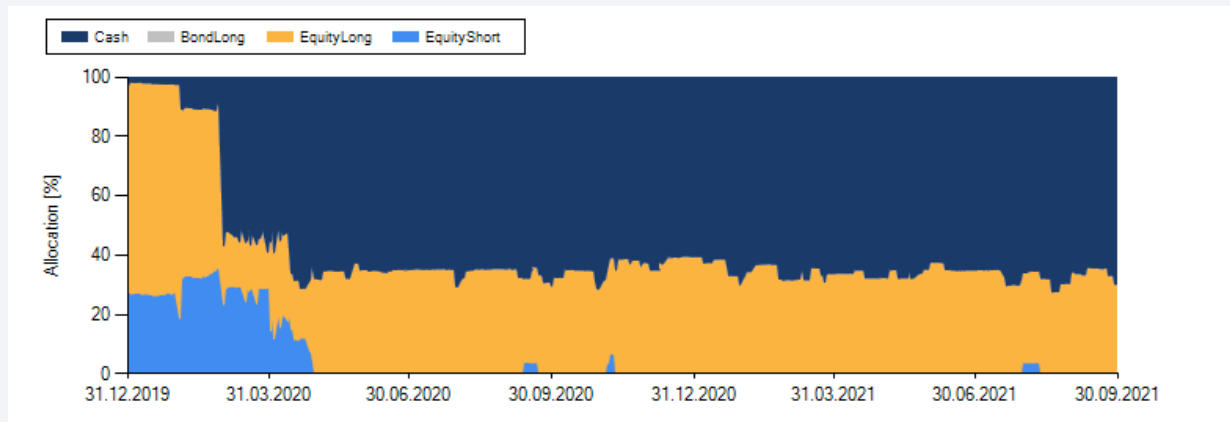
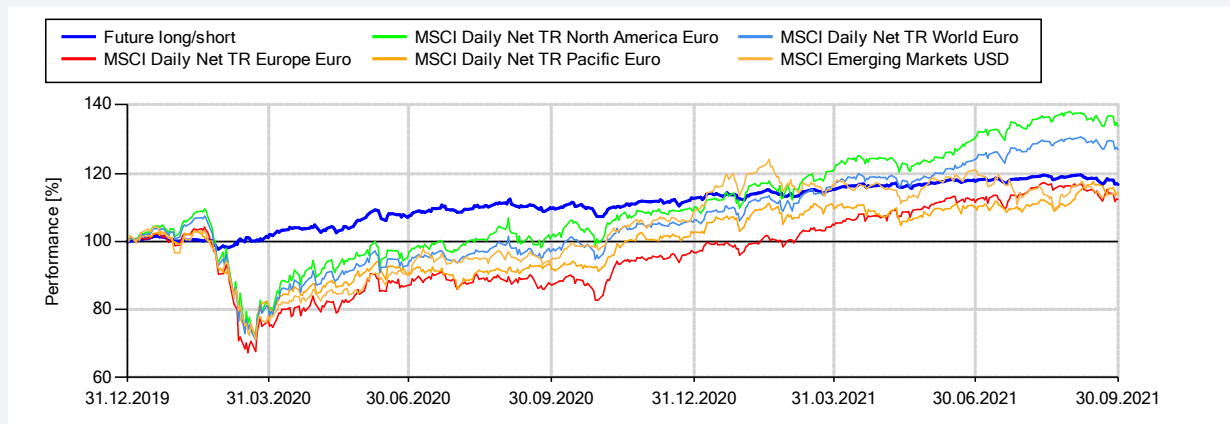
	Return p.a.	Drawdown
Future long/short	10.22%	-9.68%
MSCI Daily Net TR Europe Euro	6.17%	-58.54%
MSCI Daily Net TR North America Euro	10.47%	-51.46%
MSCI Daily Net TR Pacific Euro	6.62%	-50.30%
MSCI Daily Net TR World Euro	8.93%	-53.40%
MSCI Emerging Markets USD	9.06%	-60.01%

Performance 31.12.2019 - 30.09.2021



	Return	Drawdown
Future long/short	16.65%	-4.56%
MSCI Daily Net TR Europe Euro	12.34%	-35.25%
MSCI Daily Net TR North America Euro	33.71%	-34.37%
MSCI Daily Net TR Pacific Euro	14.38%	-29.20%
MSCI Daily Net TR World Euro	26.89%	-33.76%
MSCI Emerging Markets USD	14.03%	-31.62%

Performance 31.12.2019 - 30.09.2021



	Return	Drawdown
Future long/short	16.65%	-4.56%
MSCI Daily Net TR Europe Euro	12.34%	-35.25%
MSCI Daily Net TR North America Euro	33.71%	-34.37%
MSCI Daily Net TR Pacific Euro	14.38%	-29.20%
MSCI Daily Net TR World Euro	26.89%	-33.76%
MSCI Emerging Markets USD	14.03%	-31.62%

Performance (Monthly) - 1 Jahr

	Future long/short	Euribor 1M+400
Sep '21	-2.17%	0.28%
Aug '21	0.78%	0.30%
Jul '21	0.60%	0.28%
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%

* Stand: 30.09.2021

Drawdown (Monthly) - 1 Jahr

	Future long/short
Sep '21	-2.36%
Aug '21	-1.16%
Jul '21	-1.51%
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%

* Stand: 30.09.2021

Bestände per 30.09.2021

Futures auf Aktienindex													
Name	ISIN	Land	Whg	Verfall	Kontrakt		Vereinb Kurs	Tages		Tageswert EUR	GuV	Underl %FV	GuV %FV
					Stück	Grösse		DevKurs	Kurs				
Welt:										21.472.329	-526.980	47,46	-1,16
long:													
SPI 200 Index Future (YAP) Dez. 21	XC0005705469	AU	AUD	16.12.21	12	25,00	7.424,000	1,610	7.280,000	1.356.543	-26.833	3,00	-0,06
SPI 200 Index Future (YAP) Dez. 21					12		7.424,000			1.356.543	-26.833	3,00	-0,06
S&P Canada 60 Index Future (SXF) D	XC0009677995	CA	CAD	16.12.21	17	200,00	1.225,870	1,476	1.202,100	2.769.637	-54.766	6,12	-0,12
S&P Canada 60 Index Future (SXF) Dez.					17		1.225,870			2.769.637	-54.766	6,12	-0,12
DAX-Index Future (FDAX) Dez. 21	DE0008469594	DE	EUR	17.12.21	6	25,00	15.750,500		15.327,000	2.299.050	-63.525	5,08	-0,14
DAX-Index Future (FDAX) Dez. 21					6		15.750,500			2.299.050	-63.525	5,08	-0,14
CAC 40-Index Future (FCE) Okt. 21	XC0009654440	FR	EUR	15.10.21	44	10,00	6.701,500		6.572,500	2.891.900	-56.760	6,39	-0,13
CAC 40-Index Future (FCE) Okt. 21					44		6.701,500			2.891.900	-56.760	6,39	-0,13
AEX Future (AEX) Okt. 21	XC0009690543	NL	EUR	15.10.21	20	200,00	792,250		778,900	3.115.600	-53.400	6,89	-0,12
AEX Future (AEX) Okt. 21					20		792,250			3.115.600	-53.400	6,89	-0,12
Mini Sized DJIA Index Future (1YM) D	US12495D1081	US	USD	17.12.21	19	5,00	34.941,789	1,160	34.265,000	2.805.097	-55.405	6,20	-0,12
Mini Sized DJIA Index Future (1YM) Dez.					19		34.941,789			2.805.097	-55.405	6,20	-0,12
E-Mini S&P 500 Index Future (ES) De	XC0009656890	US	USD	17.12.21	17	50,00	4.449,000	1,160	4.349,750	3.186.081	-72.698	7,04	-0,16
E-Mini S&P 500 Index Future (ES) Dez. 2					17		4.449,000			3.186.081	-72.698	7,04	-0,16
E-Mini NASDAQ-100 Index Future (N	XC0009665289	US	USD	17.12.21	12	20,00	15.434,050	1,160	14.739,750	3.048.421	-143.593	6,74	-0,32
E-Mini NASDAQ-100 Index Future (NQ)					12		15.434,050			3.048.421	-143.593	6,74	-0,32
Welt:										21.472.329	-526.980	47,46	-1,16
Futures auf Aktienindex Gesamt										21.472.329	-526.980	47,46	-1,16

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.