

GET Pension Future Long/Short

Report Mai 2024

GET Pension Future Long/Short

Strategiebeschreibung

Renditeprofil

- **Anlagestrategie** die - je nach Marktentwicklung - sowohl auf steigende als auch auf fallende Kurse setzen kann
- Zielrendite systematische Überperformance zu **Geldmarkt plus 400 BP**

Risikoprofil

- **Absicherung** gegen mögliche Aktienmarktverluste (siehe Q1 2020)
- **niedriger Drawdown** durch Kombination von long/short und Kassepositionen
- **geringe Korrelation** zu klassischen Anlageklassen (in negativen Marktphasen)

Instrumente

- **Hochliquide** Future-Märkte global (Index-Futures)
- Kurzlaufende Staatsanleihen (Initial-Margin)
- Kasse (Währungskonten für die Variation-Margin)

Ansatz

- Nutzung von **Returnschätzern** über **verschiedene Betrachtungszeiträume**
(Verfahren der **Mustererkennung mit Machine Learning-Algorithmen**)



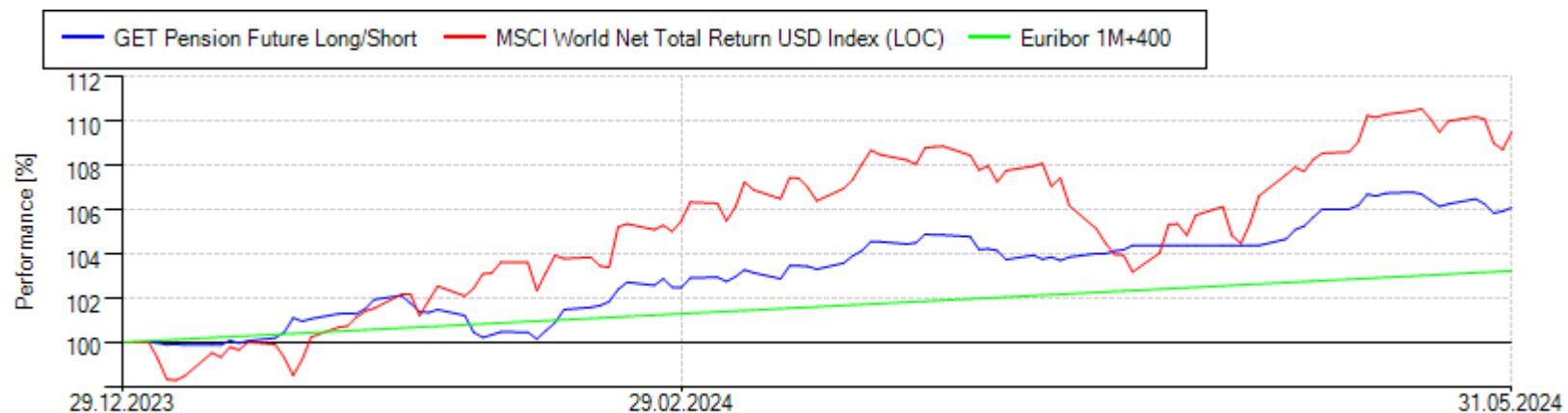
Investmentuniversum

AEX TR	AEX TR Short
CAC 40 Total Return Index	CAC 40 Total Return Index Short
DAX TR	DAX TR Short
DJ Industrial Average TR(LocalCur)	DJ Industrial Average TR(LocalCur) Short
FTSE MIB TR	FTSE MIB TR Short
FTSE UK Series FTSE 100 TR(LocalCur)	FTSE UK Series FTSE 100 TR(LocalCur) Short
Hang Seng China Enterprises In(LocalCur)	Hang Seng China Enterprises In(LocalCur) Short
Hang Seng Total Return(LocalCur)	Hang Seng Total Return(LocalCur) Short
IBEX 35 TR	IBEX 35 TR Short
MSCI Canada Local(LocalCur)	MSCI Canada Local(LocalCur) Short
NASDAQ 100 TOTAL RETURN(LocalCur)	NASDAQ 100 TOTAL RETURN(LocalCur) Short
OMX STOCKHOLM 30 TR(LOC)	OMX STOCKHOLM 30 TR(LOC) Short
SMI TR(LocalCur)	SMI TR(LocalCur) Short
SP ASX 200 TR(LOC)	SP ASX 200 TR(LOC) Short
Standard & Poors US 500 TR(LocalCur)	Standard & Poors US 500 TR(LocalCur) Short
TOPIX TR(LocalCur)	TOPIX TR(LocalCur) Short

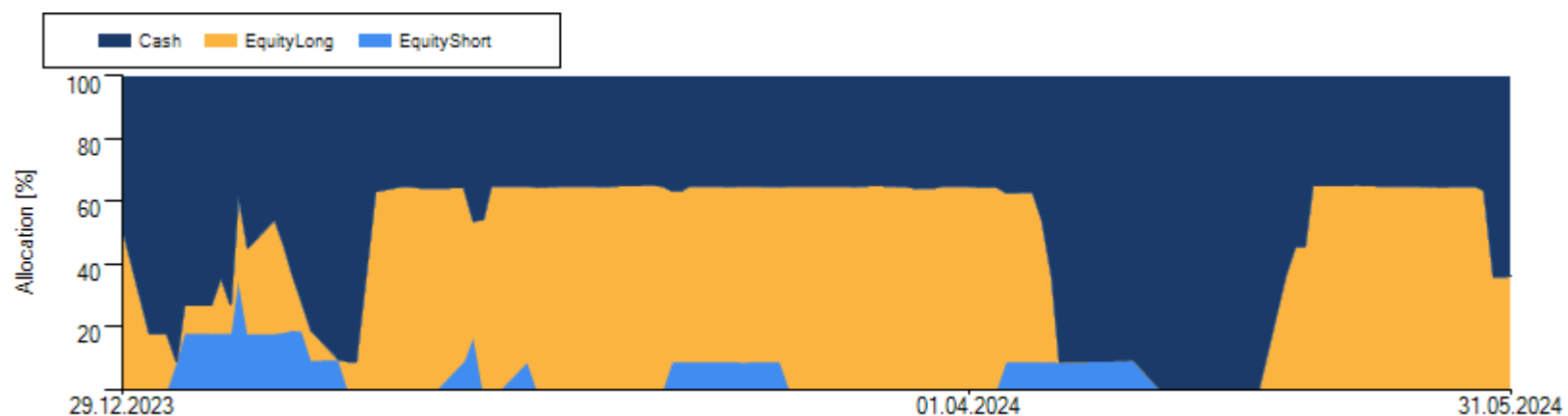


Performance laufendes Jahr 2024

29.12.2023 – 31.05.2024

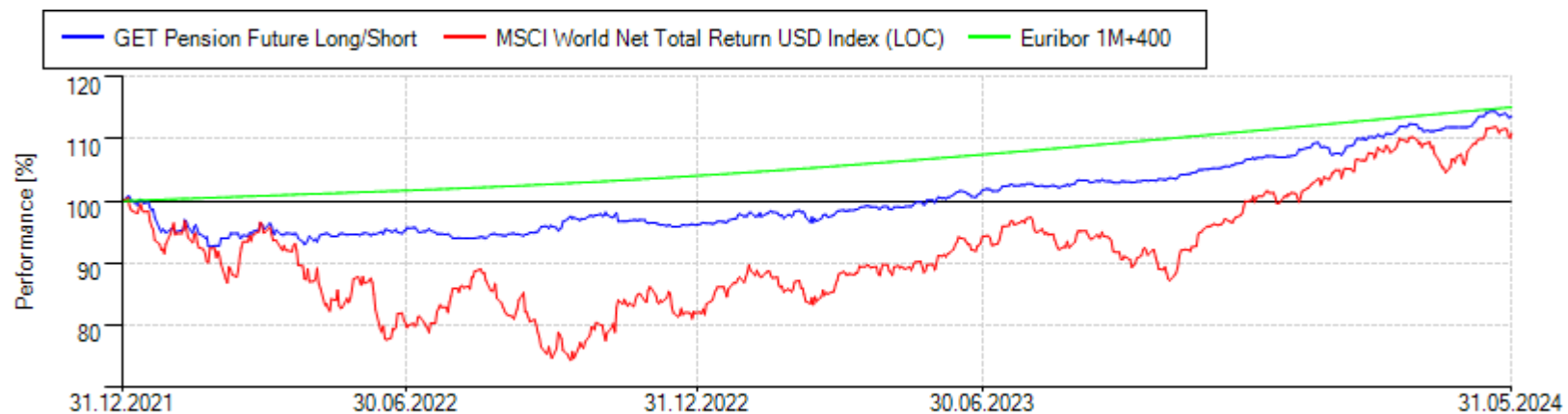


	Return	Drawdown
GET Pension Future Long/Short	6.09%	-1.93%
MSCI World Net Total Return USD Index (LOC)	9.52%	-5.23%
Euribor 1M+400	3.23%	0.00%

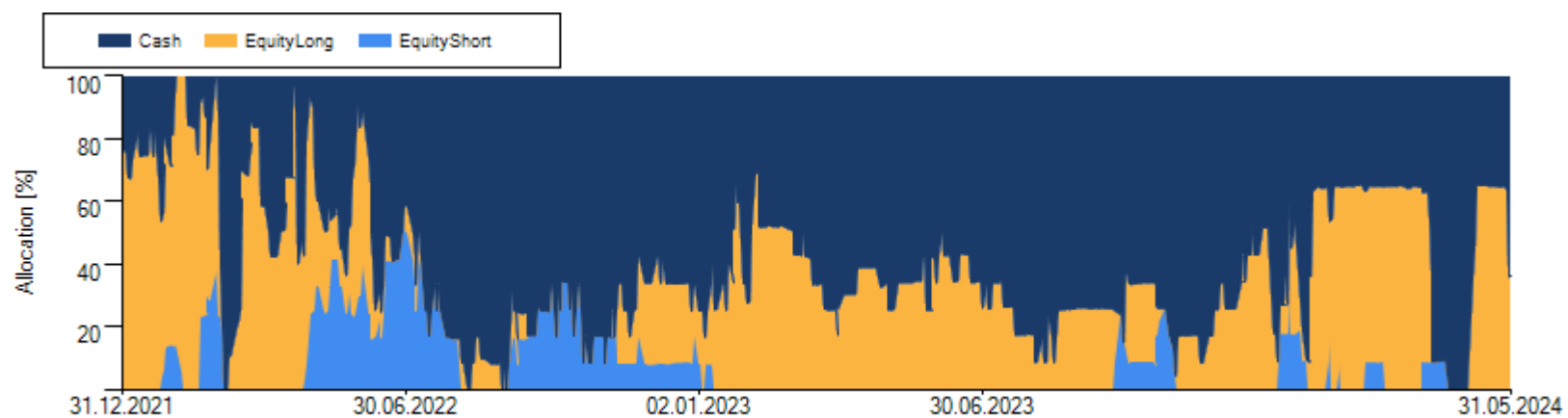


Performance seit 2022

31.12.2021 – 31.05.2024

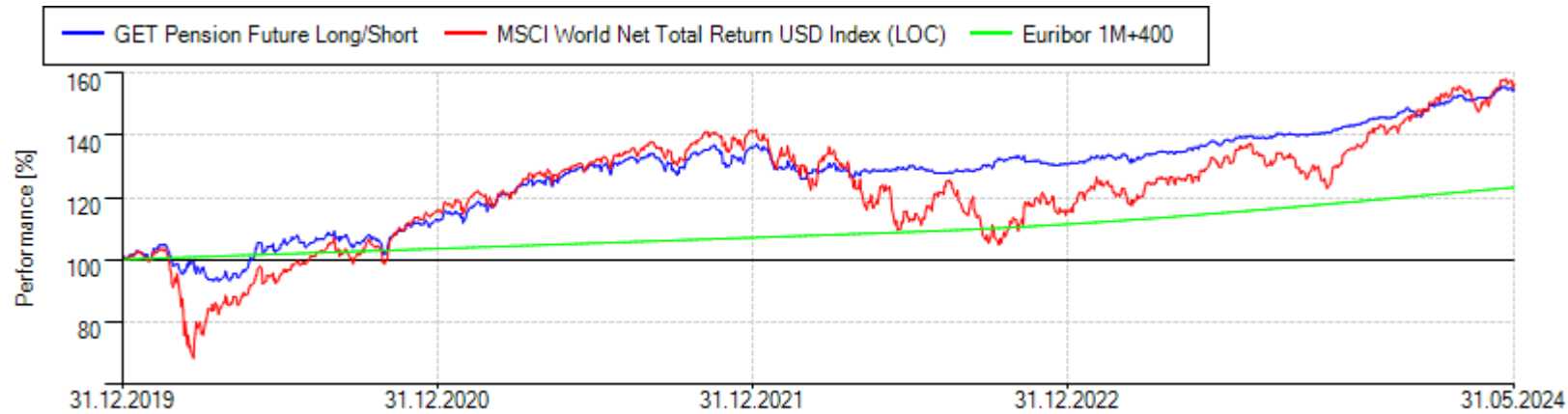


	Return	Drawdown
GET Pension Future Long/Short	13.74%	-8.12%
MSCI World Net Total Return USD Index (LOC)	10.97%	-26.12%
Euribor 1M+400	15.18%	0.00%

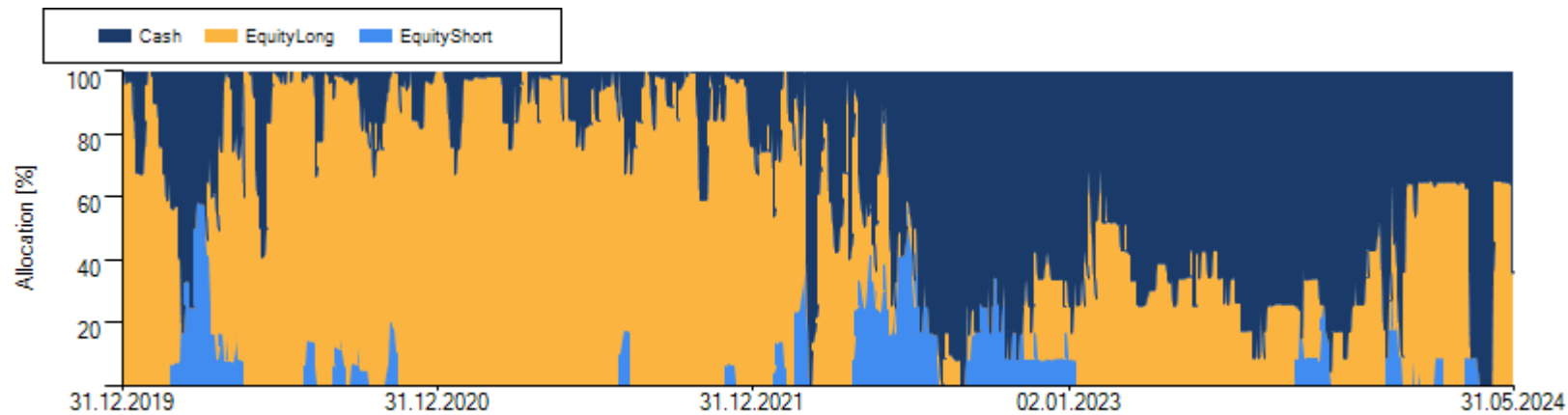


Performance seit 2020

31.12.2019 – 31.05.2024

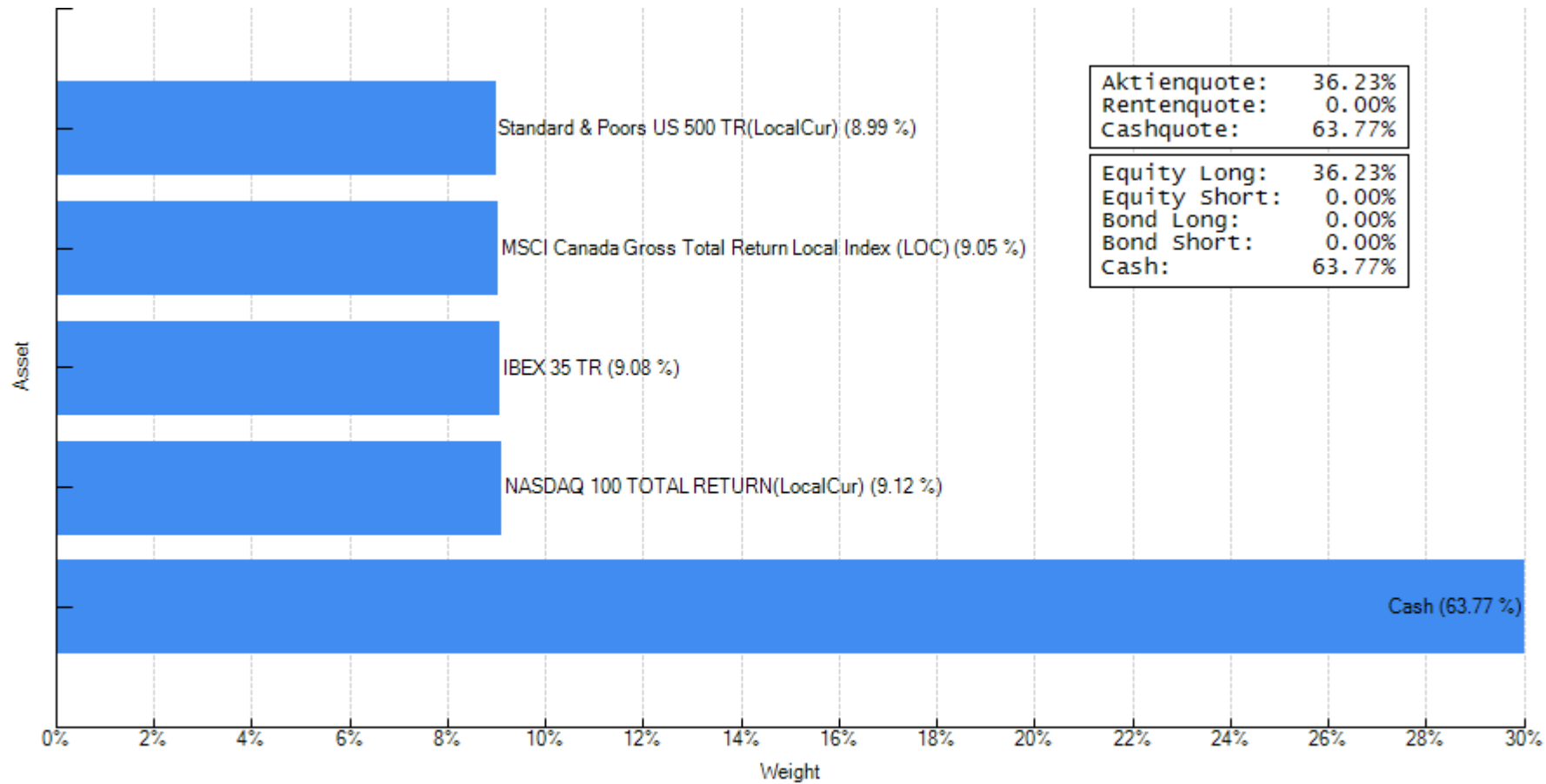


	Return p.a.	Drawdown
GET Pension Future Long/Short	10.39%	-11.34%
MSCI World Net Total Return USD Index (LOC)	10.70%	-34.03%
Euribor 1M+400	4.86%	0.00%



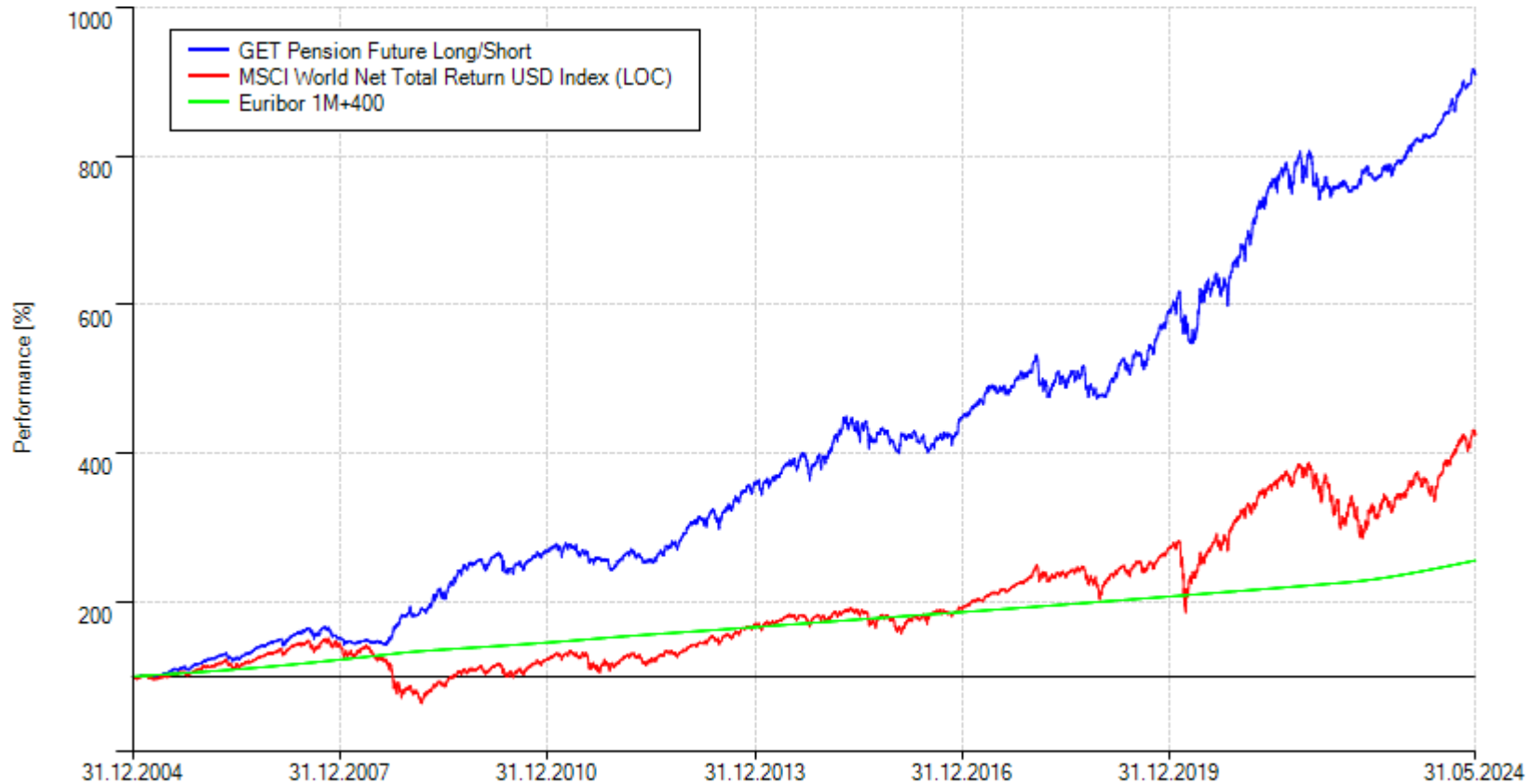
Allocation Quota (Day)

31.05.2024



Performance

31.12.2004 - 31.05.2024



	Return p.a.	Drawdown
GET Pension Future Long/Short	12.05%	-14.99%
MSCI World Net Total Return USD Index (LOC)	7.77%	-57.82%
Euribor 1M+400	4.96%	0.00%



Performance (Yearly)

31.12.2004 - 31.05.2024

	GET Pension Future Long/Short	MSCI World Net Total Return USD Index (LOC)	Euribor 1M+400
2024	6.09%	9.52%	3.23%
2023	11.57%	23.79%	7.21%
2022	-3.91%	-18.14%	4.07%
2021	20.78%	21.82%	3.44%
2020	12.65%	15.90%	3.50%
2019	23.07%	27.67%	3.60%
2018	-5.89%	-8.71%	3.65%
2017	13.66%	22.40%	3.62%
2016	7.61%	7.51%	3.65%
2015	5.45%	-0.87%	3.93%
2014	9.03%	4.94%	4.13%
2013	23.63%	26.68%	4.13%
2012	17.14%	15.83%	4.34%
2011	-6.53%	-5.54%	5.16%
2010	4.71%	11.76%	4.57%
2009	36.70%	29.99%	4.90%
2008	22.39%	-40.71%	8.27%
2007	4.56%	9.04%	8.12%
2006	24.03%	20.07%	6.91%
2005	17.63%	9.49%	6.12%

* Stand: 31.05.2024



Drawdown (Yearly)

31.12.2004 - 31.05.2024

	GET Pension Future Long/Short	MSCI World Net Total Return USD Index (LOC)
2024	-1.93%	-5.23%
2023	-1.99%	-10.52%
2022	-8.12%	-26.12%
2021	-5.29%	-5.47%
2020	-11.34%	-34.03%
2019	-4.61%	-5.94%
2018	-11.00%	-18.71%
2017	-2.65%	-1.98%
2016	-6.77%	-11.52%
2015	-9.70%	-13.85%
2014	-9.30%	-9.30%
2013	-8.35%	-7.70%
2012	-6.79%	-12.52%
2011	-13.02%	-21.98%
2010	-10.77%	-16.22%
2009	-6.85%	-27.19%
2008	-6.82%	-50.39%
2007	-9.60%	-10.83%
2006	-8.37%	-11.28%
2005	-4.60%	-6.17%

* Stand: 31.05.2024



Risk Statistics (5 Years)

31.12.2004 - 31.05.2024

	Ex Post Annualized Data									
	GET Pension Future Long/Short					MSCI World Net Total Return USD Index (LOC)				
Averaging Years	1	2	3	4	5	1	2	3	4	5
Volatility	3.20%	4.05%	6.38%	7.91%	8.71%	10.25%	14.78%	15.09%	15.00%	18.26%
Value at Risk	2.00%	2.51%	4.04%	4.64%	5.43%	8.68%	13.12%	13.31%	12.83%	12.43%
Expected Shortfall	4.21%	5.76%	9.38%	11.30%	12.48%	15.08%	21.57%	22.80%	22.54%	25.93%
Sharpe Ratio	3.25	1.83	0.83	1.29	1.29	1.90	0.69	0.35	0.84	0.63
Deutsch Ratio VaR	5.20	2.96	1.30	2.20	2.06	2.24	0.78	0.40	0.98	0.92
Deutsch Ratio ESf	2.47	1.29	0.56	0.90	0.90	1.29	0.48	0.23	0.56	0.44

Stand: 31.05.2024

Sharpe Ratio = Excess Return / Volatilität

Deutsch Ratio = Excess Return / Risk of Excess Return



Performance Annualised

31.12.2004 - 31.05.2024

		GET Pension Future Long/Short
YTD*		6.09%
1 Jahr		14.07%
3 Jahre	p.a.	6.59%
5 Jahre		12.44%
7 Jahre		9.31%
10 Jahre		9.09%

* Stand: 31.05.2024



KONTAKT



Harald Schnorrenberg

+49 2161 30735 – 22

schnorrenberg@get-capital.de

www.get-capital.de

Mönchengladbach

Heinz-Nixdorf-Straße 31

41179 Mönchengladbach

Düsseldorf

Schulstraße 2

40213 Düsseldorf

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.

