

INVESTMENTSTRATEGIE

GJK ist ein Managed Futures Fonds, welcher mit Unterstützung eines selbst entwickelten IT-Handelssystems verwaltet wird. Die Strategie basiert auf Trendfolge und einem Absolute Return-Ansatz. Die Finanzinstrumente sind ausschließlich Futures und Geldmarktinstrumente. Das gesamte Handelssystem baut auf drei Säulen auf: Technische und Fundamentale Analyse, Diversifikation und Risikomanagement. Die meisten Positionen im Fonds werden generell in US-Dollar gehalten, es erfolgt grundsätzlich kein Hedging. Der Fonds kann sowohl von steigenden wie auch von fallenden Märkten profitieren.

FONDS MANAGER



Göran Jenisch

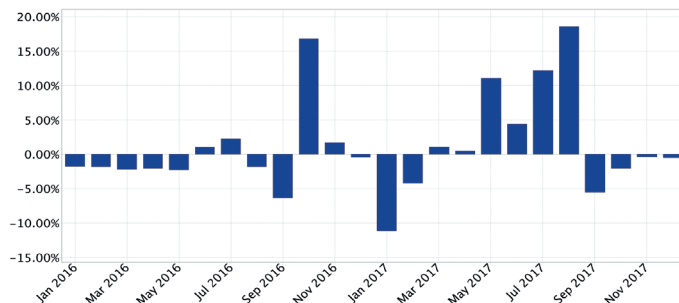


Georg Koschitz

INFORMATIONEN ZUM FONDS

| | |
|--------------------------------|--|
| Fondsname | GJK |
| Währung | EUR |
| ISIN | AT0000A287Q1 |
| Domizil | Österreich |
| Fondstyp | offener Investmentfonds |
| Verwaltungsgesellschaft (AIFM) | GJK Fondsverwaltung GmbH |
| Aufsichtsbehörde | Finanzmarktaufsicht Österreich (FMA) |
| Zulassung | registrierter alternativer Investmentfonds (AIF) |
| Auflagedatum | 2019 |
| Mindestinvestment | € 50.000,- |
| Ausgabeaufschlag | 5% 3% ab € 150.000,- 1% ab € 500.000,- |
| Management Fee | 0,2% p.m. |
| Performance Fee | 20% (High-Water-Mark) |
| Ertragsverwendung | thesaurierend |
| Beteiligung und Kündigung | monatlich |
| Empfohlene Haltedauer | mindestens 3 Jahre |
| Homepage | www.gjk.at |

TEST-PERFORMANCE



Performance in Prozent, **Real Time Testing**, Daten von Interactive Brokers (2016 und 2017)

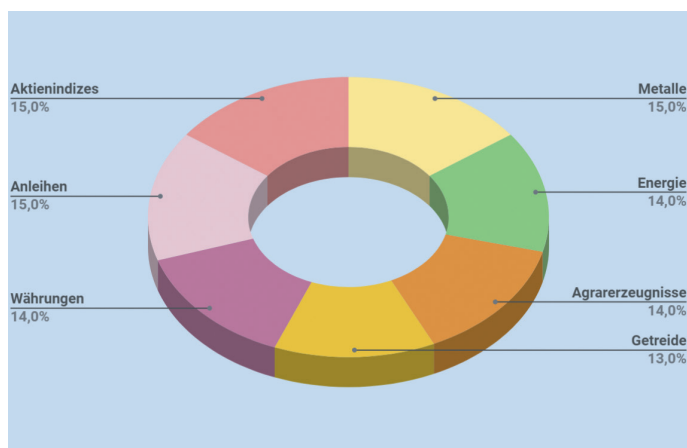
ERTRAG

| | |
|------------------|-------|
| Performance p.a. | 13,4% |
| Sharpe Ratio | 0,52 |
| Sortino Ratio | 0,52 |
| Calmar Ratio | 0,75 |

RISIKO

| | |
|----------------------|--------|
| Volatilität p.a. | 23,8% |
| Maximaler Verlust | -15,2% |
| Downside Volatilität | 12,2% |
| SRRI (laut KID) | 6 |

VERMÖGENSVERTEILUNG



Gehandelte Märkte, schematische Darstellung

Der Fonds GJK wurde jahrelang mittels Simulationen bzw teilweise auch mit realem Kapital getestet. Nachdem ein gewisses Niveau an Robustheit im Handelssystem ersichtlich war, wurde der komplette Handelsansatz mit realem Kapital (Real Time Testing) in den Jahren 2016 und 2017 durchgeführt. Dieses Real Time Testing wurde bewusst mit höherem Risiko ausgeführt, um zusätzlich die Stabilität des Fonds zu testen.

Das durchschnittliche Ziel pro Jahr von GJK ist eine Rendite von 10% mit einer Volatilität von 15% nach Abzug aller Gebühren und vor Steuern für die Investoren zu erreichen.

RECHTLICHER HINWEIS

Diese Informationen stellen weder eine Empfehlung noch ein Angebot oder eine Aufforderung zur Abgabe eines Angebots zur Zeichnung bzw. zur Rücknahme von Anteilen des GJK Fonds dar. Für die Richtigkeit dieser Angaben wird keine Verantwortung und/oder Haftung übernommen. Investments sollten erst nach genauer Durchsicht der aktuellen Fondsbestimmungen und nach Rücksprache mit der Fondsgesellschaft getätigt werden. Es bestehen bei der Anlage in Managed Futures erhebliche Risiken, ein Gesamtverlust des eingesetzten Kapitals kann nicht ausgeschlossen werden. Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung. Der GJK Fonds darf ausschließlich an in Österreich ansässige professionelle Anleger (§ 2 Abs. 1 Z. 33 AIFMG) sowie an in Österreich ansässige qualifizierte Privatkunden (§ 2 Abs. 1 Z. 42 AIFMG), nicht aber an (sonstige) Privatkunden (§ 2 Abs. 1 Z. 36 AIFMG) oder an US-Staatsbürger, auch wenn diese in Österreich ansässig sein sollten, vertrieben werden.
© 2020 GJK Fondsverwaltung GmbH. Alle Rechte vorbehalten.

KONTAKT: GJK Fondsverwaltung GmbH, +43 678 129 27 90, office@gjk.at, www.gjk.at