



## GET Capital ESG Multi Asset bis 31.05.2021

---

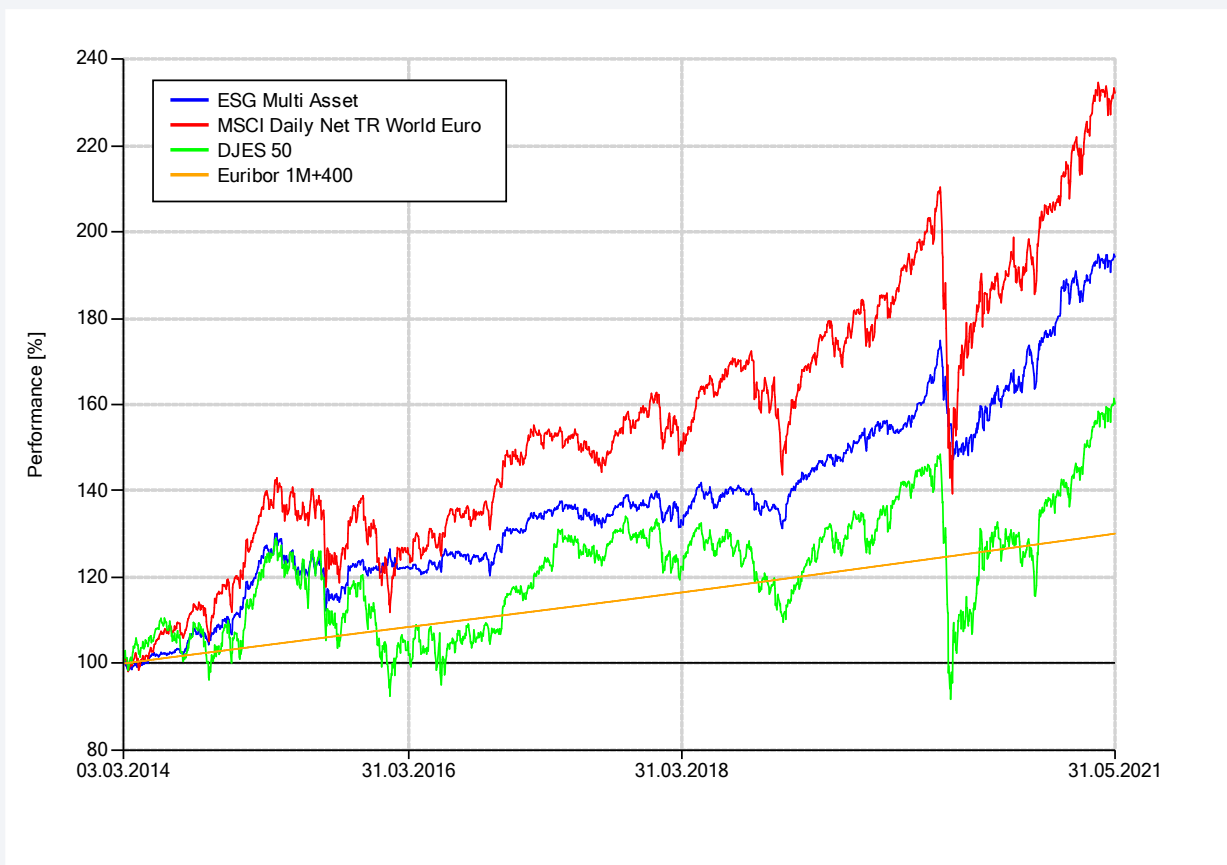
## Fondsprofil

- Strategie: ESG Multi Asset Long/Short
- Nachhaltigkeit: wird über ein MSCI Scoring berücksichtigt
- Umsetzungsinstrumente: ETF und Future
- Investmentstrategie: Risikoadjustierter Ansatz,  
Einsatz regimeorientierter Returnschätzer
- Zielrendite: Euribor 1 Monat plus 400 Basispunkte
- Portfolio Charakteristik: Absolute Return

# Investmentuniversum

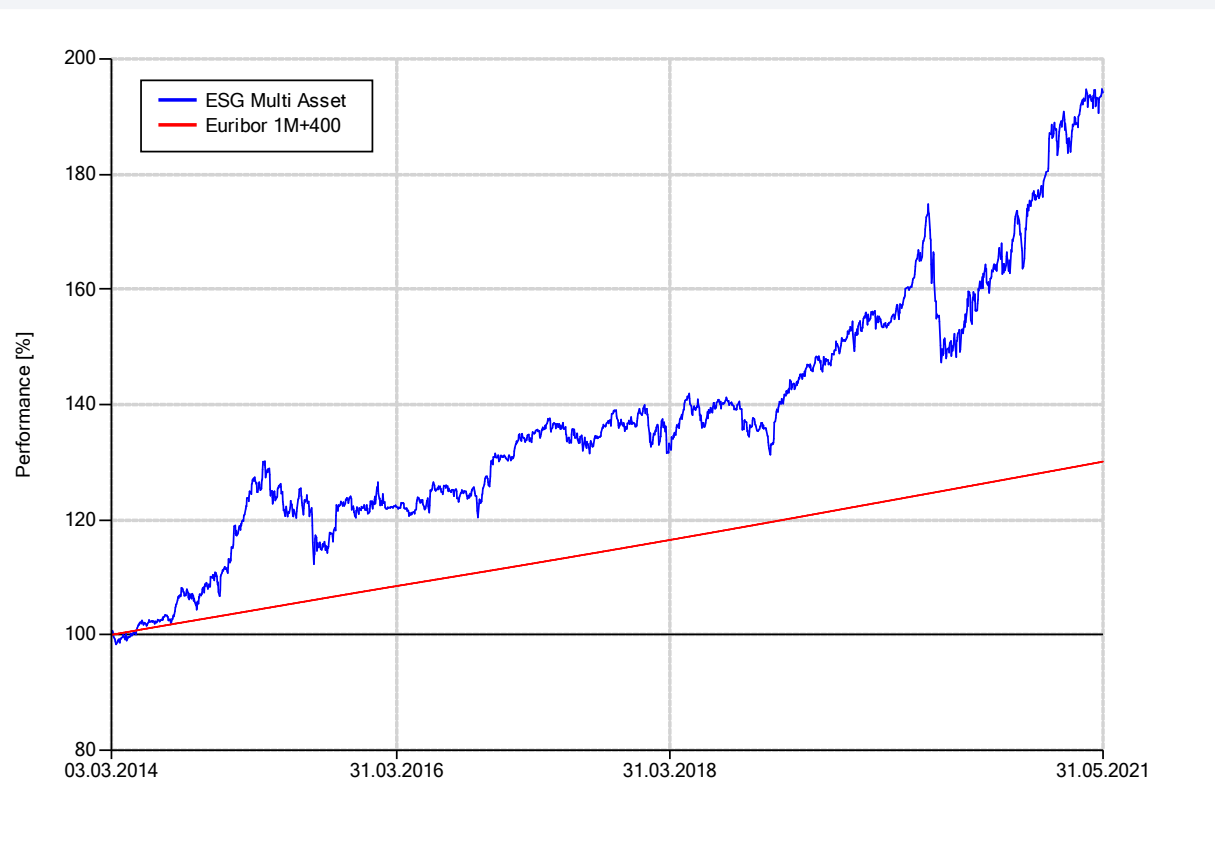
Bond - long	EUR Governments	ETF	Equity - long	FTSE European Property Yield	ETF
Bond - long	EUR Governments 5-7Y	ETF	Equity - long	MSCI Australia	ETF
Bond - long	EUR Governments 7-10Y	ETF	Equity - long	MSCI Canada	ETF
Bond - long	EUR Governments 15+Y	ETF	Equity - long	MSCI EM SRI	ETF
Bond - long	EUR Governments Germany 10+Y	ETF	Equity - long	MSCI EM Taiwan	ETF
Bond - long	EUR Corporates 1-5Y	ETF	Equity - long	MSCI Japan SRI EUR Hedged	ETF
Bond - long	EUR Corporates Bond	ETF	Equity - long	MSCI South Africa	ETF
Bond - long	EUR Corporates Financials	ETF	Equity - long	MSCI USA Quality Factor	ETF
Bond - long	GBP Governments UK	ETF	Equity - long	MSCI World	ETF
Bond - long	GBP Inflation Linkers	ETF	Equity - long	OMX Stockholm Capped	ETF
Bond - long	GBP Corporates	ETF	Equity - long	S&P Global Clean Energy	ETF
Bond - long	USD Governments 7-10Y	ETF	Equity - long	S&P Global Timber & Forestry	ETF
Bond - long	USD Governments 20+Y EUR Hedged	ETF	Equity - long	S&P US Industrials	ETF
Bond - long	USD Aggregate Bond	ETF	Equity - long	S&P US Information Technology	ETF
Bond - long	USD Floating Rate Bond 0-5Y	ETF	Equity - long	S&P US Utilities	ETF
Bond - long	Governments Global	ETF	Equity - long	STOXX Europe 600	ETF
Bond - long	Inflation Linkers Global	ETF	Equity - long	STOXX Europe Food & Beverage	ETF
Equity - long	ATX	ETF	Equity - long	STOXX Europe Health Care	ETF
Equity - long	DAX	ETF	Equity - long	STOXX Europe Media	ETF
Equity - long	DJ AsiaPacific Select Dividend	ETF	Equity - long	STOXX Europe Oil & Gas	ETF
Equity - long	DJ Industrial Average	ETF	Equity - long	STOXX Europe Retail	ETF
Equity - long	DJ Sustainability World Enlarged	ETF	Equity - long	STOXX Europe Technology	ETF
Equity - long	EURO STOXX 50	ETF	Equity - long	STOXX Europe Telecom	ETF
Equity - long	EURO STOXX Banks	ETF	Equity - long	STOXX Europe Utilities	ETF
Equity - long	EURO STOXX Telecom	ETF	Equity - short	DJ Industrial Average USD short	Future
Equity - long	FTSE 100	ETF	Equity - short	FTSE 100 GBP short	Future
			Equity - short	TOPIX JPY short	Future
			Equity - short	FTSE MIB short	Future
			Equity - short	DAX short	Future
			Equity - short	AEX short	Future
			Equity - short	EURO STOXX 50 short	Future

## Performance 03.03.2014 - 31.05.2021



	Return p.a.	Drawdown
ESG Multi Asset	9.59%	-15.74%
MSCI Daily Net TR World Euro	12.32%	-33.76%
DJES 50	6.71%	-38.24%
Euribor 1M+400	3.70%	0.00%

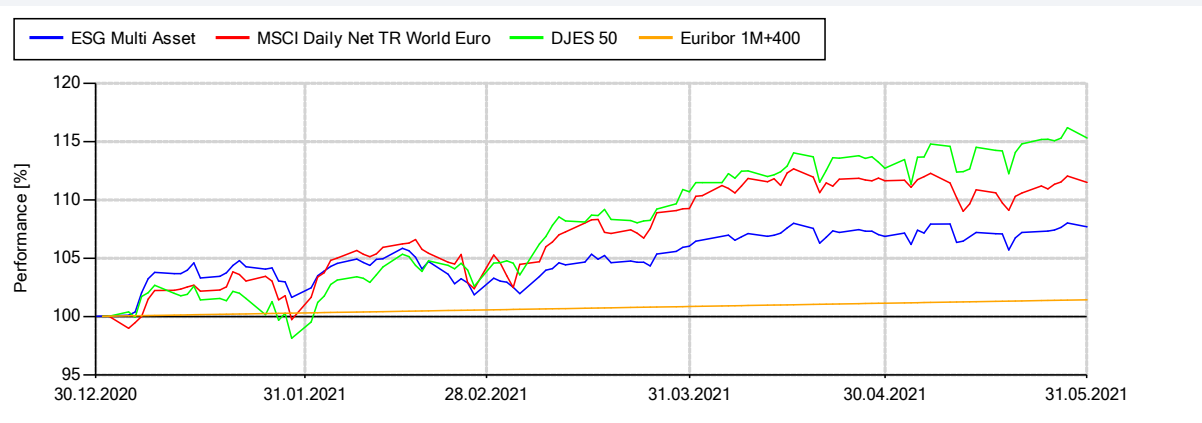
## Performance 03.03.2014 - 31.05.2021



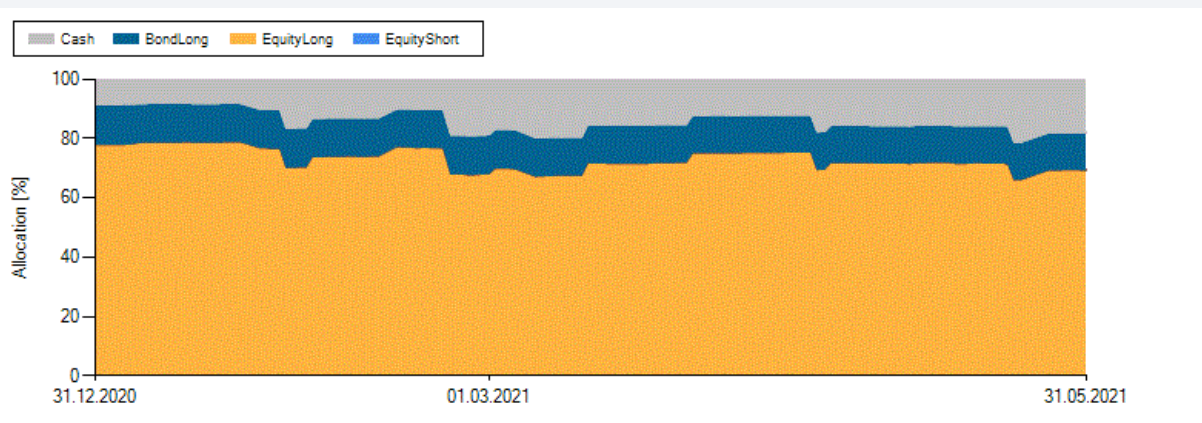
	Return p.a.	Drawdown
ESG Multi Asset	9.59%	-15.74%
Euribor 1M+400	3.70%	0.00%

# Performance laufendes Jahr

## 31.12.2020 - 31.05.2021



	Return	Drawdown
ESG Multi Asset	7.66%	-3.77%
MSCI Daily Net TR World Euro	11.47%	-3.96%
DJES 50	15.27%	-4.42%
Euribor 1M+400	1.41%	0.00%



## Performance (Yearly)

03.03.2014 - 31.05.2021

	ESG Multi Asset	MSCI Daily Net TR World Euro	DJES 50	Euribor 1M+400
<b>2021</b>	7.66%	11.47%	15.27%	1.41%
<b>2020</b>	12.82%	6.33%	-3.21%	3.50%
<b>2019</b>	19.93%	30.02%	28.20%	3.60%
<b>2018</b>	-2.07%	-4.11%	-12.03%	3.65%
<b>2017</b>	4.66%	7.51%	9.15%	3.62%
<b>2016</b>	6.61%	10.73%	3.72%	3.65%
<b>2015</b>	9.52%	10.42%	6.42%	3.93%
<b>2014</b>	11.43%	19.54%	5.65%	3.40%

\* Stand: 31.05.2021

## Drawdown (Yearly)

03.03.2014 - 31.05.2021

	ESG Multi Asset	MSCI Daily Net TR World Euro	DJES 50
2021	-3.77%	-3.96%	-4.42%
2020	-15.74%	-33.76%	-38.24%
2019	-3.36%	-5.98%	-7.27%
2018	-7.48%	-16.61%	-17.89%
2017	-4.43%	-7.00%	-6.38%
2016	-4.85%	-15.27%	-17.80%
2015	-13.76%	-17.70%	-19.74%
2014	-3.71%	-7.94%	-12.96%

\* Stand: 31.05.2021



# Performance (Monthly)

## - 1 Jahr

	ESG Multi Asset	MSCI Daily Net TR World Euro	DJES 50	Euribor 1M+400
<b>Mai '21</b>	0.76%	-0.12%	2.30%	0.29%
<b>Apr '21</b>	0.79%	2.18%	1.82%	0.28%
<b>Mrz '21</b>	4.10%	6.71%	7.88%	0.31%
<b>Feb '21</b>	0.21%	2.66%	4.54%	0.26%
<b>Jan '21</b>	1.62%	-0.29%	-1.88%	0.27%
<b>Dez '20</b>	2.71%	1.91%	1.77%	0.29%
<b>Nov '20</b>	7.16%	9.83%	18.09%	0.29%
<b>Okt '20</b>	-2.27%	-2.42%	-7.31%	0.28%
<b>Sep '20</b>	1.47%	-1.53%	-2.33%	0.28%
<b>Aug '20</b>	3.69%	5.48%	3.18%	0.29%
<b>Jul '20</b>	1.19%	-0.48%	-1.61%	0.29%
<b>Jun '20</b>	2.14%	1.66%	6.40%	0.30%
<b>Mai '20</b>	2.01%	3.22%	4.74%	0.28%

\* Stand: 31.05.2021

## Drawdown (Monthly)

- 1 Jahr

	ESG Multi Asset	MSCI Daily Net TR World Euro	DJES 50
<b>Mai '21</b>	-2.06%	-2.90%	-2.22%
<b>Apr '21</b>	-1.58%	-1.81%	-2.21%
<b>Mrz '21</b>	-1.28%	-2.64%	-1.15%
<b>Feb '21</b>	-3.77%	-3.96%	-2.60%
<b>Jan '21</b>	-3.00%	-3.95%	-4.42%
<b>Dez '20</b>	-1.07%	-0.93%	-3.15%
<b>Nov '20</b>	-0.81%	-1.17%	-1.13%
<b>Okt '20</b>	-5.79%	-6.43%	-10.27%
<b>Sep '20</b>	-3.18%	-6.18%	-5.98%
<b>Aug '20</b>	-1.17%	-0.88%	-3.08%
<b>Jul '20</b>	-2.99%	-3.56%	-6.78%
<b>Jun '20</b>	-3.54%	-6.49%	-7.31%
<b>Mai '20</b>	-2.52%	-3.13%	-5.36%

\* Stand: 31.05.2021

# Performance Annualised

## 03.03.2014 - 31.05.2021

		ESG Multi Asset	MSCI Daily Net TR World Euro	DJES 50	Euribor 1M+400
YTD*		7.66%	11.47%	15.27%	1.41%
1 Jahr		25.93%	27.94%	35.47%	3.48%
3 Jahre	p.a.	12.01%	12.64%	8.24%	3.55%
5 Jahre		9.47%	12.10%	8.27%	3.58%
7 Jahre		9.63%	11.93%	5.78%	3.68%

\* Stand: 31.05.2021

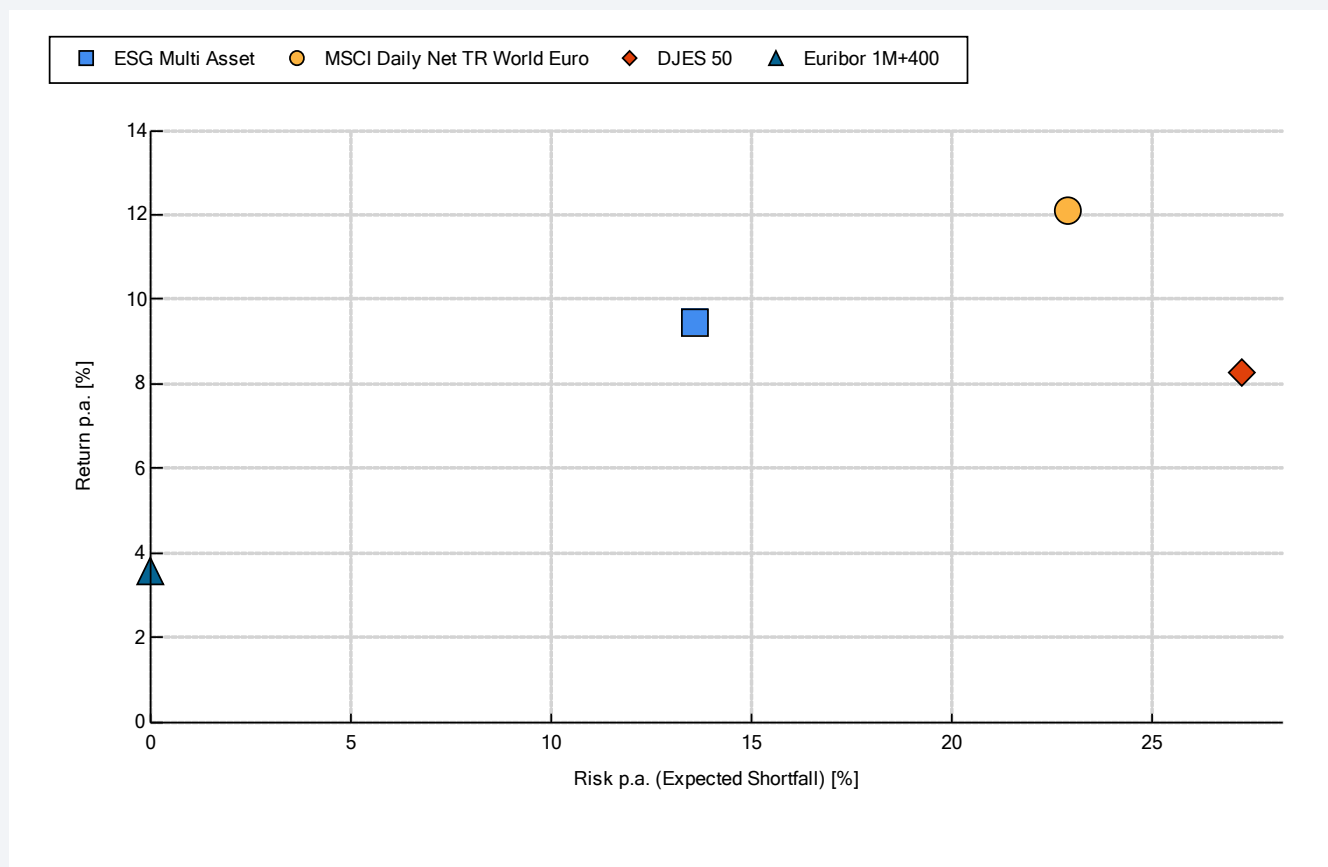
## Risk Statistics (5 Years) - 31.05.2021

	Ex Post Annualized Data									
	ESG Multi Asset					MSCI Daily Net TR World Euro				
	1	2	3	4	5	1	2	3	4	5
<b>Averaging Years</b>										
<b>Volatility</b>	11.70%	11.50%	10.18%	9.64%	9.07%	14.74%	22.29%	19.51%	17.73%	16.51%
<b>Value at Risk</b>	8.27%	7.54%	6.87%	6.90%	6.46%	10.39%	10.32%	10.06%	9.71%	9.20%
<b>Expected Shortfall</b>	17.46%	18.11%	15.60%	14.74%	13.57%	21.05%	31.21%	27.27%	24.78%	22.88%
<b>Sharpe Ratio</b>	2.09	1.31	1.20	1.00	1.07	1.71	0.73	0.63	0.63	0.72
<b>Deutsch Ratio VaR</b>	2.96	1.99	1.78	1.39	1.50	2.42	1.57	1.23	1.15	1.29
<b>Deutsch Ratio ESf</b>	1.40	0.83	0.78	0.65	0.71	1.20	0.52	0.45	0.45	0.52

Stand: 31.05.2021

Sharpe Ratio = Excess Return / Volatilität  
 Deutsch Ratio = Excess Return / Risk of Excess Return

## Return vs. Risk (5 Years) - 31.05.2021



# 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.