



## GET Capital ESG Multi Asset bis 30.06.2021

---

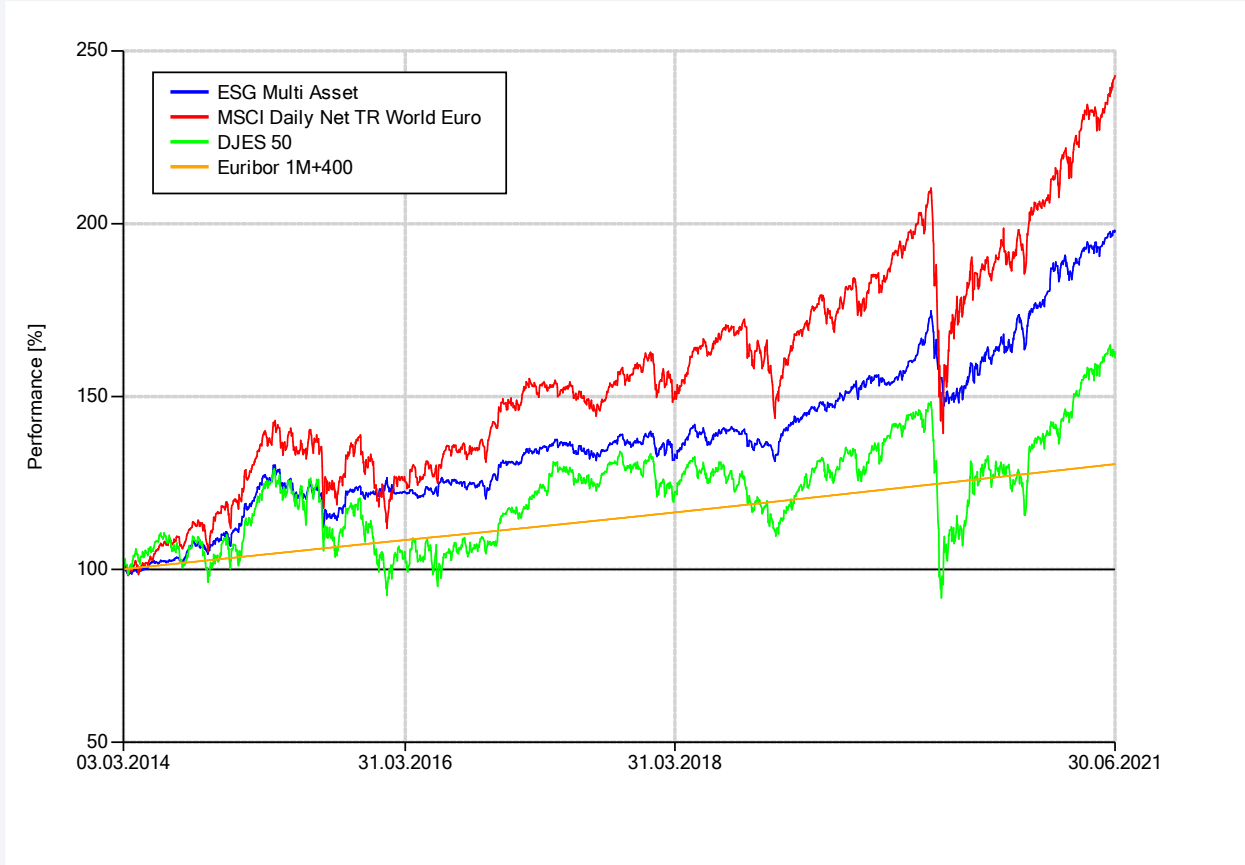
## Fondsprofil

- 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

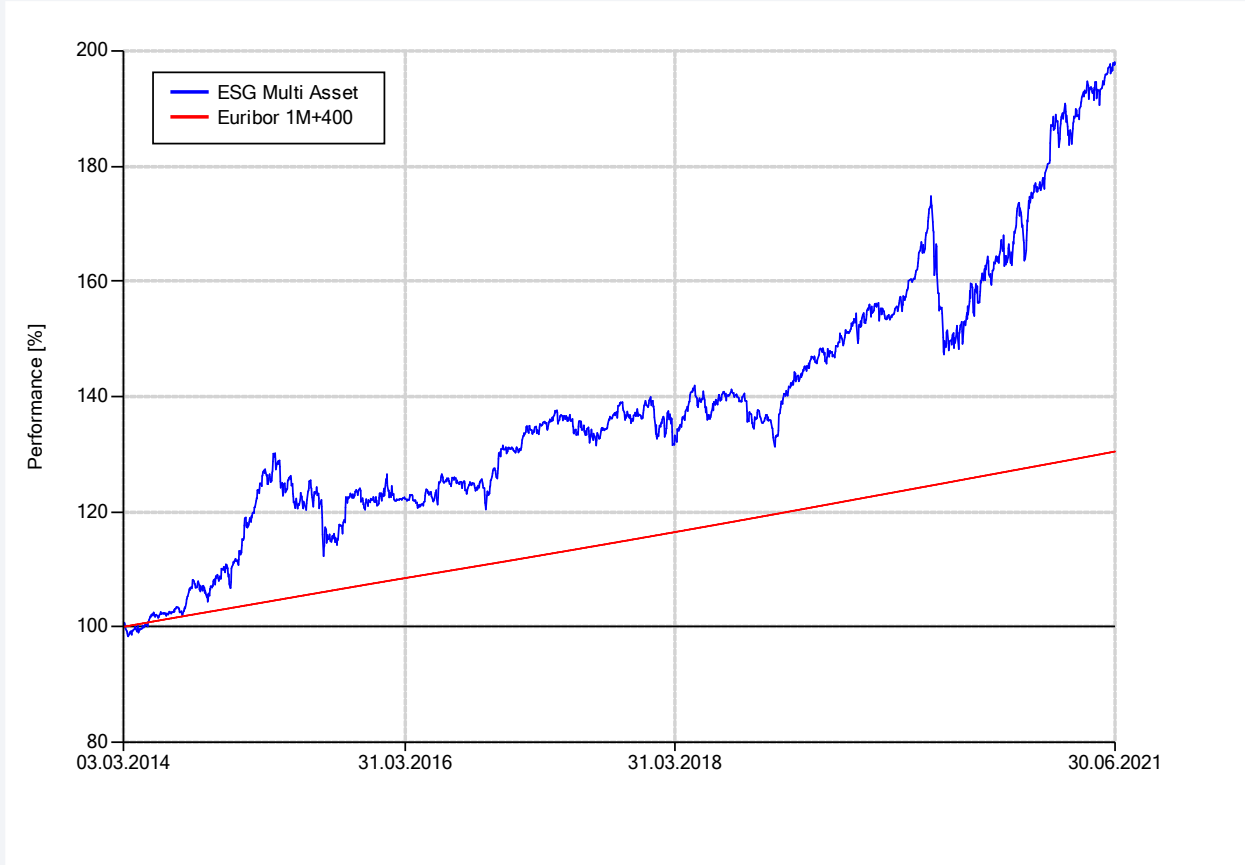
|               |                                  |     |                |                                 |        |
|---------------|----------------------------------|-----|----------------|---------------------------------|--------|
| Bond - long   | EUR Governments                  | ETF | Equity - 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 - 30.06.2021



|                              | Return p.a. | Drawdown |
|------------------------------|-------------|----------|
| ESG Multi Asset              | 9.75%       | -15.74%  |
| MSCI Daily Net TR World Euro | 12.87%      | -33.76%  |
| DJES 50                      | 6.74%       | -38.24%  |
| Euribor 1M+400               | 3.69%       | 0.00%    |

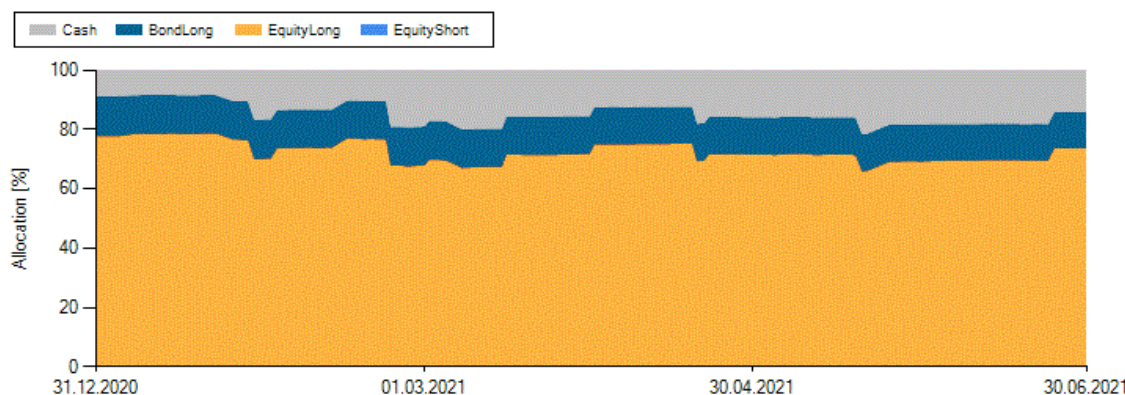
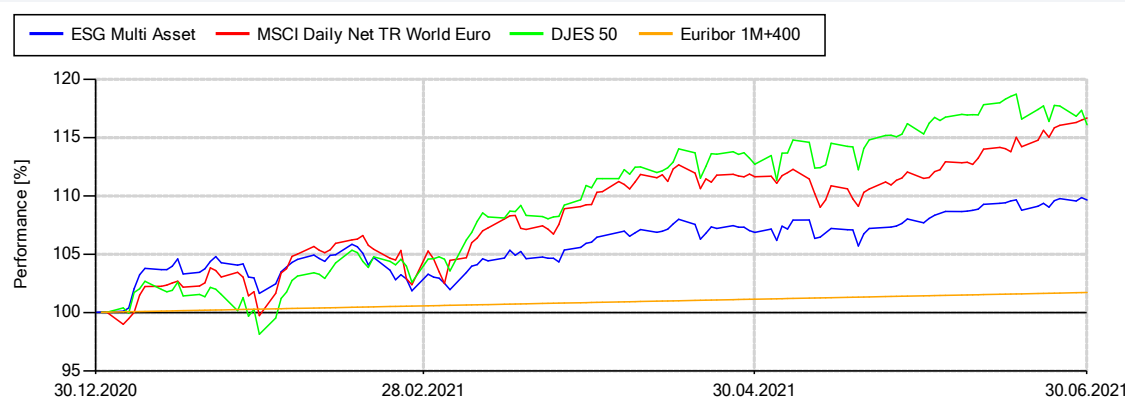
# Performance 03.03.2014 - 30.06.2021



|                 | Return p.a. | Drawdown |
|-----------------|-------------|----------|
| ESG Multi Asset | 9.75%       | -15.74%  |
| Euribor 1M+400  | 3.69%       | 0.00%    |

# Performance laufendes Jahr

## 31.12.2020 - 30.06.2021



|                              | Return | Drawdown |
|------------------------------|--------|----------|
| ESG Multi Asset              | 9.61%  | -3.77%   |
| MSCI Daily Net TR World Euro | 16.64% | -3.96%   |
| DJES 50                      | 16.06% | -4.42%   |
| Euribor 1M+400               | 1.69%  | 0.00%    |

## Performance (Yearly)

03.03.2014 - 30.06.2021

|             | ESG Multi Asset | MSCI Daily Net TR<br>World Euro | DJES 50 | Euribor 1M+400 |
|-------------|-----------------|---------------------------------|---------|----------------|
| <b>2021</b> | 9.61%           | 16.64%                          | 16.06%  | 1.69%          |
| <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: 30.06.2021

## Drawdown (Yearly)

03.03.2014 - 30.06.2021

|      | 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: 30.06.2021

## Performance (Monthly)

### - 1 Jahr

|                | ESG Multi Asset | MSCI Daily Net TR<br>World Euro | DJES 50 | Euribor 1M+400 |
|----------------|-----------------|---------------------------------|---------|----------------|
| <b>Jun '21</b> | 1.82%           | 4.64%                           | 0.68%   | 0.28%          |
| <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%          |

\* Stand: 30.06.2021

## Drawdown (Monthly)

### - 1 Jahr

|         | ESG Multi Asset | MSCI Daily Net TR<br>World Euro | DJES 50 |
|---------|-----------------|---------------------------------|---------|
| Jun '21 | -0.81%          | -0.69%                          | -2.20%  |
| Mai '21 | -2.06%          | -2.90%                          | -2.22%  |
| Apr '21 | -1.58%          | -1.81%                          | -2.21%  |
| Mrz '21 | -1.28%          | -2.64%                          | -1.15%  |
| Feb '21 | -3.77%          | -3.96%                          | -2.60%  |
| Jan '21 | -3.00%          | -3.95%                          | -4.42%  |
| Dez '20 | -1.07%          | -0.93%                          | -3.15%  |
| Nov '20 | -0.81%          | -1.17%                          | -1.13%  |
| Okt '20 | -5.79%          | -6.43%                          | -10.27% |
| Sep '20 | -3.18%          | -6.18%                          | -5.98%  |
| Aug '20 | -1.17%          | -0.88%                          | -3.08%  |
| Jul '20 | -2.99%          | -3.56%                          | -6.78%  |
| Jun '20 | -3.54%          | -6.49%                          | -7.31%  |

\* Stand: 30.06.2021

## Performance Annualised

03.03.2014 - 30.06.2021

|         |      | ESG Multi Asset | MSCI Daily Net<br>TR World Euro | DJES 50 | Euribor 1M+400 |
|---------|------|-----------------|---------------------------------|---------|----------------|
| YTD*    |      | 9.61%           | 16.64%                          | 16.06%  | 1.69%          |
| 1 Jahr  |      | 25.53%          | 31.69%                          | 28.20%  | 3.45%          |
| 3 Jahre | p.a. | 13.04%          | 14.37%                          | 8.55%   | 3.54%          |
| 5 Jahre |      | 9.58%           | 13.33%                          | 9.82%   | 3.58%          |
| 7 Jahre |      | 9.89%           | 12.43%                          | 5.93%   | 3.67%          |

\* Stand: 30.06.2021

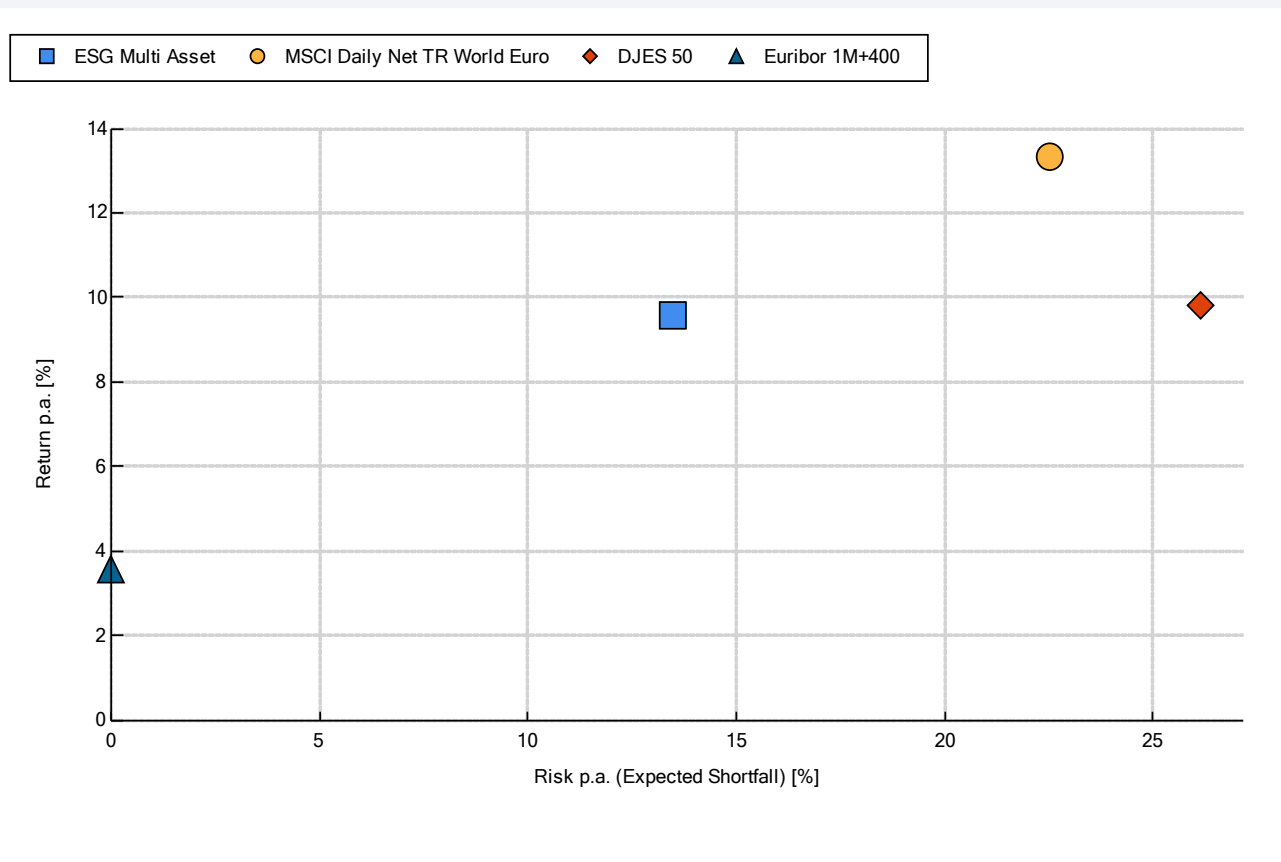
## Risk Statistics (5 Years) - 30.06.2021

|                    | Ex Post Annualized Data |        |        |        |        |                              |        |        |        |        |
|--------------------|-------------------------|--------|--------|--------|--------|------------------------------|--------|--------|--------|--------|
|                    | ESG Multi Asset         |        |        |        |        | MSCI Daily Net TR World Euro |        |        |        |        |
| Averaging Years    | 1                       | 2      | 3      | 4      | 5      | 1                            | 2      | 3      | 4      | 5      |
| Volatility         | 10.50%                  | 11.44% | 10.08% | 9.61%  | 9.01%  | 12.70%                       | 22.23% | 19.47% | 17.72% | 16.40% |
| Value at Risk      | 7.47%                   | 7.54%  | 6.74%  | 6.82%  | 6.32%  | 9.45%                        | 10.32% | 10.01% | 9.45%  | 8.98%  |
| Expected Shortfall | 15.77%                  | 18.18% | 15.35% | 14.66% | 13.48% | 17.87%                       | 30.97% | 27.10% | 24.67% | 22.51% |
| Sharpe Ratio       | 2.29                    | 1.33   | 1.31   | 1.09   | 1.09   | 2.21                         | 0.73   | 0.71   | 0.71   | 0.79   |
| Deutsch Ratio VaR  | 3.22                    | 2.01   | 1.96   | 1.54   | 1.55   | 2.97                         | 1.58   | 1.39   | 1.33   | 1.44   |
| Deutsch Ratio ESf  | 1.53                    | 0.83   | 0.86   | 0.72   | 0.73   | 1.57                         | 0.53   | 0.51   | 0.51   | 0.58   |

Stand: 30.06.2021

Sharpe Ratio =  $\frac{\text{Excess Return}}{\text{Volatilität}}$   
 Deutsch Ratio =  $\frac{\text{Excess Return}}{\text{Risk of Excess Return}}$

## Return vs. Risk (5 Years) - 30.06.2021



# Kontakt



**Harald Schnorrenberg**

CEO/ Partner

Tel: +49 (0)2161 307 35 22

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



**Marco Wunderlich**

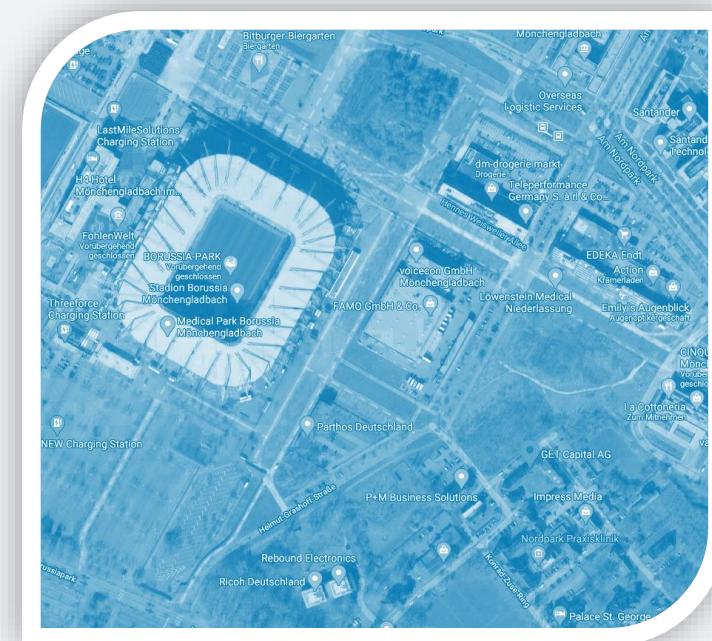
Head of Institutional Sales

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.