



GET Capital ESG Multi Asset bis 30.06.2022

Profil der Strategie ESG Multi Asset long/short

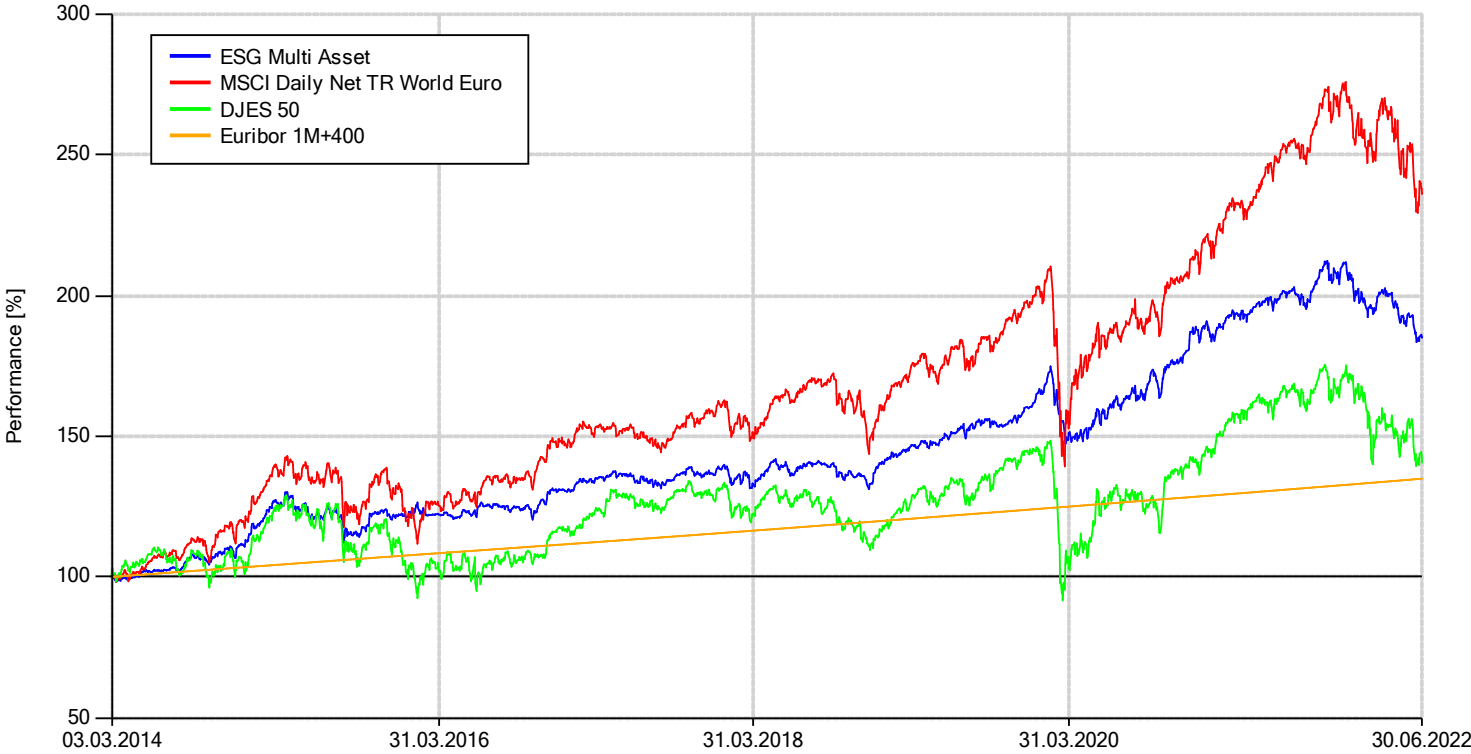
- Strategie: ESG Multi Asset long/short
- Nachhaltigkeit: wird über ein MSCI Scoring berücksichtigt
- Umsetzungsinstrumente: ETF und Future
- Investmentstrategie: Risikoadjustierter Ansatz,
Einsatz regimeorientierter Returnschätzer
- Zielrendite: Euribor 1 Monat plus 400 Basispunkte
- Portfolio Charakteristik: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

Performance 03.03.2014 - 30.06.2022



	Return p.a.	Drawdown
ESG Multi Asset	7.66%	-15.74%
Euribor 1M+400	3.66%	0.00%

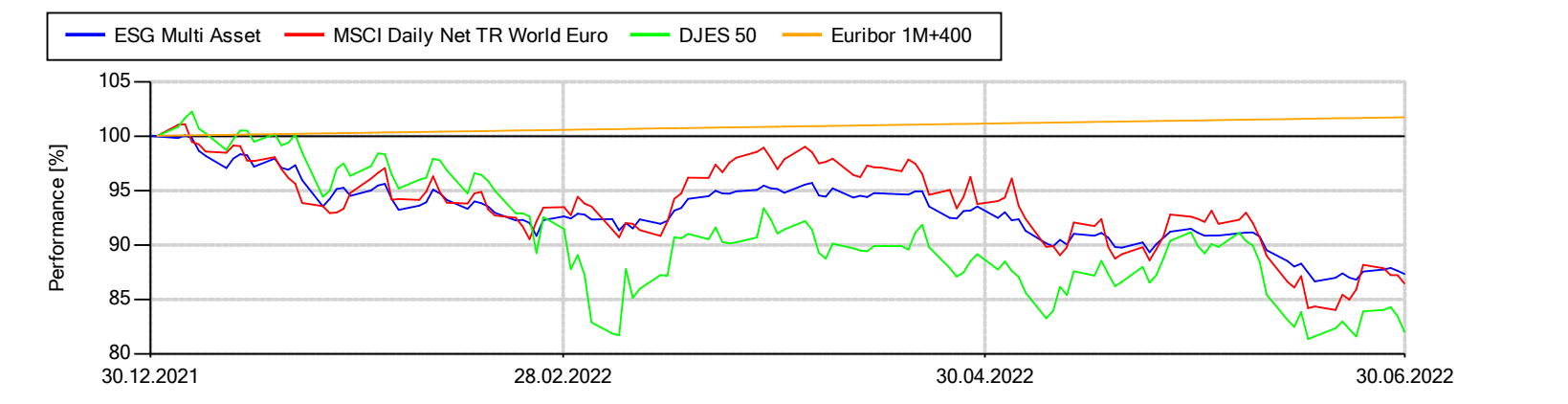
Performance 03.03.2014 - 30.06.2022



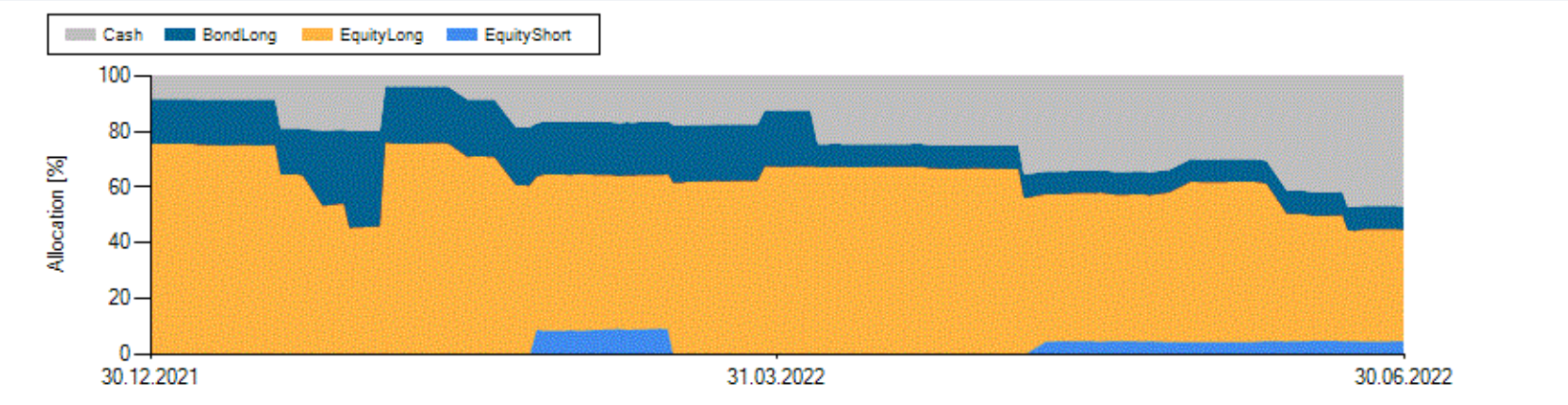
	Return p.a.	Drawdown
ESG Multi Asset	7.66%	-15.74%
MSCI Daily Net TR World Euro	10.86%	-33.76%
DJES 50	4.18%	-38.24%
Euribor 1M+400	3.66%	0.00%

Performance laufendes Jahr

30.12.2021 - 30.06.2022



	Return	Drawdown
ESG Multi Asset	-12.65%	-13.39%
MSCI Daily Net TR World Euro	-13.53%	-16.85%
DJES 50	-17.95%	-20.40%
Euribor 1M+400	1.70%	0.00%



Performance (Yearly) 03.03.2014 - 30.06.2022

	ESG Multi Asset	MSCI Daily Net TR World Euro	DJES 50	Euribor 1M+400
2022	-12.65%	-13.53%	-17.95%	1.70%
2021	17.39%	31.07%	23.34%	3.44%
2020	12.82%	6.33%	-3.21%	3.50%
2019	19.93%	30.02%	28.20%	3.60%
2018	-2.07%	-4.11%	-12.03%	3.65%
2017	4.66%	7.51%	9.15%	3.62%
2016	6.61%	10.73%	3.72%	3.65%
2015	9.52%	10.42%	6.42%	3.93%
2014	11.43%	19.54%	5.65%	3.40%

* Stand: 30.06.2022

Drawdown (Yearly) 03.03.2014 - 30.06.2022

	ESG Multi Asset	MSCI Daily Net TR World Euro	DJES 50
2022	-13.39%	-16.85%	-20.40%
2021	-3.92%	-4.61%	-7.64%
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: 30.06.2022

Performance (Monthly) – 1 Jahr

	ESG Multi Asset	MSCI Daily Net TR World Euro	DJES 50	Euribor 1M+400
Jun '22	-4.14%	-6.41%	-8.76%	0.28%
Mai '22	-2.57%	-1.45%	0.87%	0.30%
Apr '22	-1.68%	-3.29%	-2.08%	0.27%
Mrz '22	2.71%	3.72%	-0.46%	0.29%
Feb '22	-2.51%	-2.72%	-5.92%	0.26%
Jan '22	-5.00%	-3.92%	-2.78%	0.29%
Dez '21	2.98%	3.21%	5.81%	0.28%
Nov '21	0.18%	0.56%	-4.33%	0.30%
Okt '21	4.03%	5.82%	5.15%	0.27%
Sep '21	-2.19%	-2.37%	-3.41%	0.28%
Aug '21	1.69%	2.95%	2.63%	0.30%
Jul '21	0.33%	1.80%	0.72%	0.28%
Jun '21	1.82%	4.64%	0.68%	0.28%

* Stand: 30.06.2022

Drawdown (Monthly) – 1 Jahr

	ESG Multi Asset	MSCI Daily Net TR World Euro	DJES 50
Jun '22	-4.92%	-9.77%	-10.69%
Mai '22	-4.49%	-7.80%	-6.60%
Apr '22	-3.41%	-5.71%	-5.51%
Mrz '22	-1.65%	-3.94%	-10.66%
Feb '22	-5.00%	-6.73%	-9.28%
Jan '22	-6.51%	-8.07%	-7.63%
Dez '21	-2.72%	-2.97%	-3.95%
Nov '21	-3.22%	-3.52%	-7.64%
Okt '21	-1.06%	-1.21%	-1.30%
Sep '21	-3.13%	-2.82%	-4.74%
Aug '21	-1.17%	-1.25%	-2.48%
Jul '21	-2.45%	-2.60%	-4.14%
Jun '21	-0.81%	-0.69%	-2.20%

* Stand: 30.06.2022

Performance Annualised 03.03.2014 - 30.06.2022

		ESG Multi Asset	MSCI Daily Net TR World Euro	DJES 50	Euribor 1M+400
YTD*		-12.65%	-13.53%	-17.95%	1.70%
1 Jahr		-6.45%	-2.83%	-12.80%	3.44%
3 Jahre	p.a.	7.41%	10.06%	2.00%	3.48%
5 Jahre		6.73%	9.55%	2.48%	3.54%
7 Jahre		6.30%	8.51%	2.63%	3.59%

* Stand: 30.06.2022

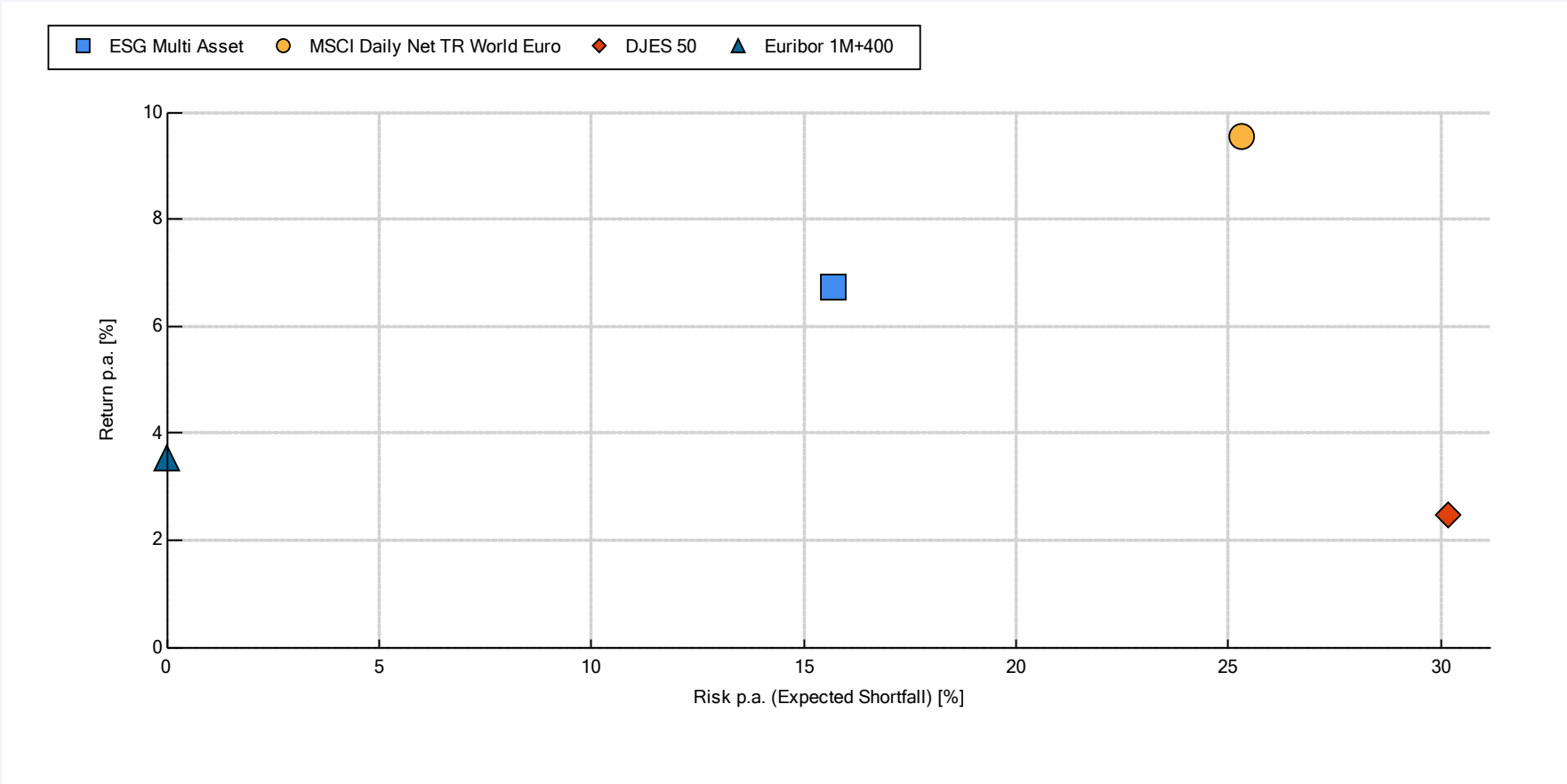
Risk Statistics (5 Years) - 30.06.2022

	Ex Post Annualized Data									
	ESG Multi Asset					MSCI Daily Net TR World Euro				
	1	2	3	4	5	1	2	3	4	5
Averaging Years										
Volatility	11.04%	10.81%	11.32%	10.34%	9.92%	16.30%	14.63%	20.44%	18.73%	17.44%
Value at Risk	9.96%	8.51%	8.51%	7.32%	7.29%	14.04%	11.24%	11.28%	10.82%	10.33%
Expected Shortfall	19.39%	17.59%	18.66%	16.50%	15.71%	27.31%	22.81%	29.88%	27.27%	25.31%
Sharpe Ratio	-0.59	0.81	0.69	0.79	0.71	-0.15	0.87	0.49	0.52	0.54
Deutsch Ratio VaR	-0.65	1.02	0.92	1.12	0.97	-0.18	1.13	0.88	0.90	0.92
Deutsch Ratio ESf	-0.33	0.49	0.42	0.49	0.45	-0.09	0.56	0.33	0.36	0.37

Stand: 30.06.2022

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

Return vs. Risk (5 Years) - 30.06.2022



Kontakt



Harald Schnorrenberg

CEO/ Partner

Tel: +49 (0)2161 307 35 22

E-Mail: schnorrenberg@get-capital.de



Marco Wunderlich

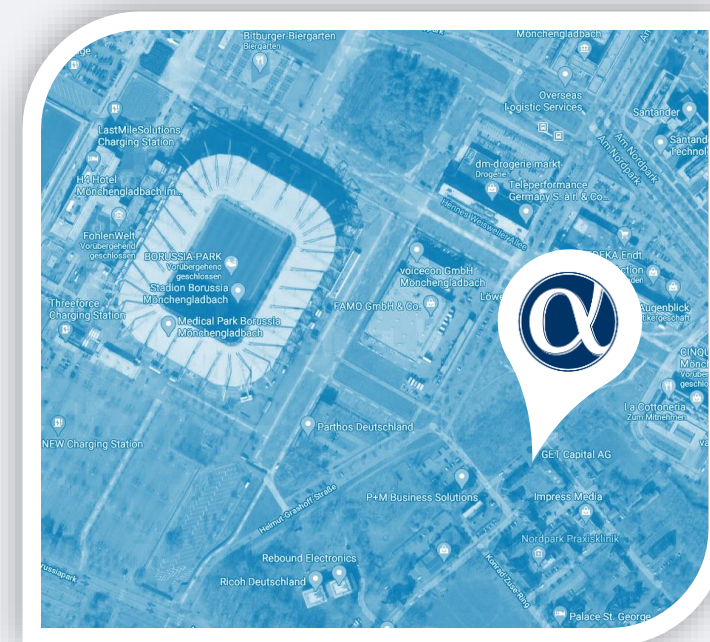
Head of Institutional Sales

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.