



# GET Capital ESG Multi Asset

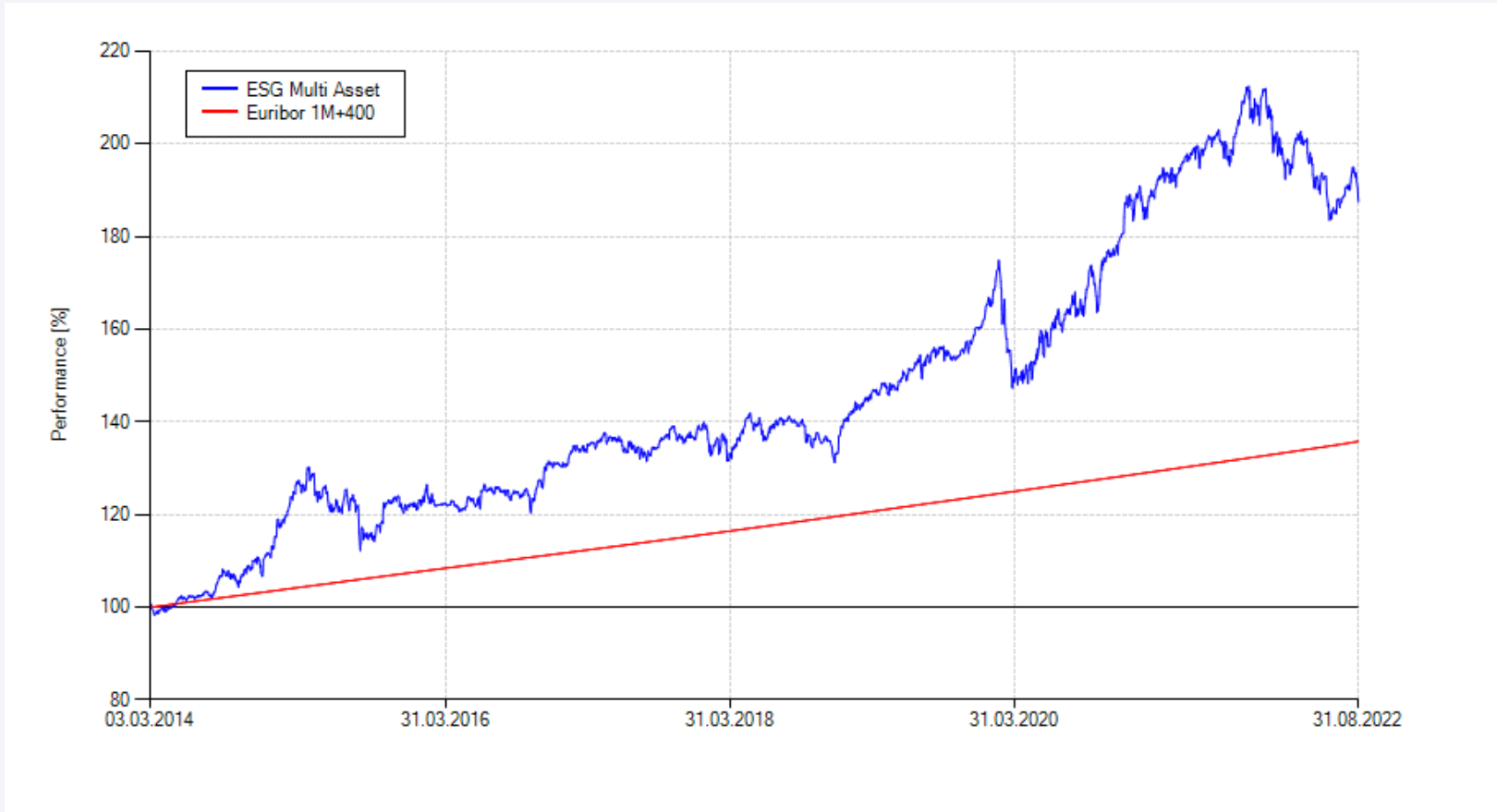
---

Report August 2022

# Profil der Strategie ESG Multi Asset long/short

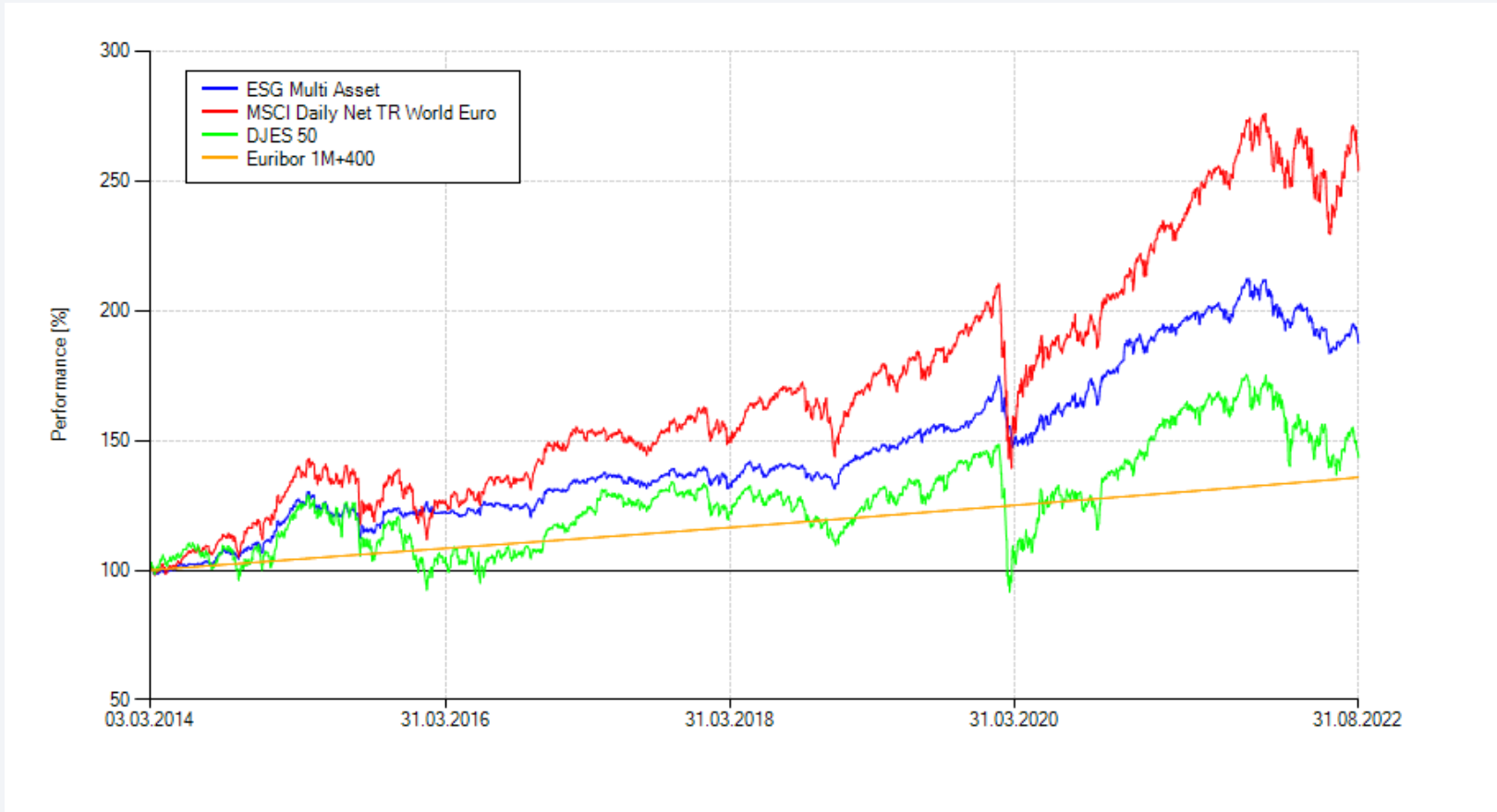
Strategie:	ESG Multi Asset long/short
Nachhaltigkeit:	wird über ein MSCI Scoring berücksichtigt
Umsetzungsinstrumente:	ETF und Future
Investmentstrategie:	Risikoadjustierter Ansatz, Einsatz regimeorientierter Returnschätzer
Zielrendite:	Euribor 1 Monat plus 400 Basispunkte
Portfolio Charakteristik:	Absolute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

# Performance 03.03.2014 - 31.08.2022



	Return p.a.	Drawdown
ESG Multi Asset	7.67%	-15.74%
Euribor 1M+400	3.67%	0.00%

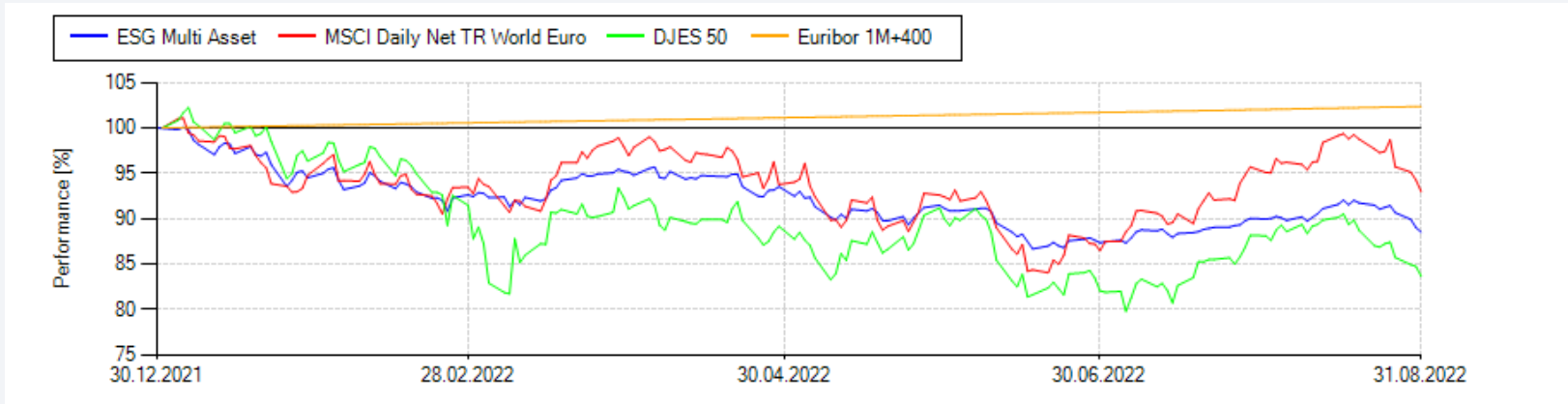
# Performance 03.03.2014 - 31.08.2022



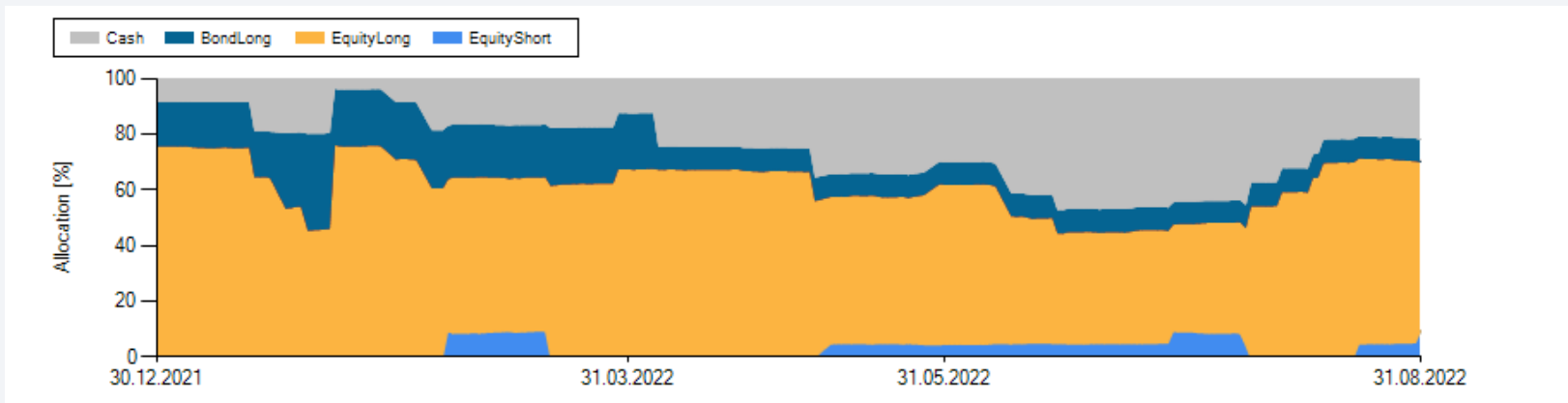
	Return p.a.	Drawdown
ESG Multi Asset	7.67%	-15.74%
MSCI Daily Net TR World Euro	11.58%	-33.76%
DJES 50	4.33%	-38.24%
Euribor 1M+400	3.67%	0.00%

# Performance laufendes Jahr

30.12.2021 - 31.08.2022



	Return	Drawdown
ESG Multi Asset	-11.49%	-13.39%
MSCI Daily Net TR World Euro	-7.02%	-16.85%
DJES 50	-16.34%	-21.94%
Euribor 1M+400	2.35%	0.00%



# Performance (Yearly) 03.03.2014 - 31.08.2022

	ESG Multi Asset	MSCI Daily Net TR World Euro	DJES 50	Euribor 1M+400
<b>2022</b>	-11.49%	-7.02%	-16.34%	2.35%
<b>2021</b>	17.39%	31.07%	23.34%	3.44%
<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: 31.08.2022

# Drawdown (Yearly) 03.03.2014 - 31.08.2022

	ESG Multi Asset	MSCI Daily Net TR World Euro	DJES 50
<b>2022</b>	-13.39%	-16.85%	-21.94%
<b>2021</b>	-3.92%	-4.61%	-7.64%
<b>2020</b>	-15.74%	-33.76%	-38.24%
<b>2019</b>	-3.36%	-5.98%	-7.27%
<b>2018</b>	-7.48%	-16.61%	-17.89%
<b>2017</b>	-4.43%	-7.00%	-6.38%
<b>2016</b>	-4.85%	-15.27%	-17.80%
<b>2015</b>	-13.76%	-17.70%	-19.74%
<b>2014</b>	-3.71%	-7.94%	-12.96%

\* Stand: 31.08.2022

# Performance (Monthly) laufendes Jahr 2022

	ESG Multi Asset	MSCI Daily Net TR World Euro	DJES 50	Euribor 1M+400
Aug '22	-1.67%	-2.84%	-5.10%	0.36%
Jul '22	3.05%	10.67%	7.44%	0.29%
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%

\* Stand: 31.08.2022



# Drawdown (Monthly) laufendes Jahr 2022

	ESG Multi Asset	MSCI Daily Net TR World Euro	DJES 50
Aug '22	-3.84%	-6.42%	-7.57%
Jul '22	-1.01%	-1.64%	-3.14%
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%

\* Stand: 31.08.2022

# Performance Annualised 03.03.2014 - 31.08.2022

		ESG Multi Asset	MSCI Daily Net TR World Euro	DJES 50	Euribor 1M+400
<b>YTD*</b>		-11.49%	-7.02%	-16.34%	2.35%
<b>1 Jahr</b>		-7.09%	-0.30%	-13.99%	3.51%
<b>3 Jahre</b>	<b>p.a.</b>	6.54%	12.10%	3.07%	3.49%
<b>5 Jahre</b>		7.07%	11.52%	2.96%	3.55%
<b>7 Jahre</b>		6.97%	10.52%	3.58%	3.59%

\* Stand: 31.08.2022

# Risk Statistics (5 Years) - 31.08.2022

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	10.96%	10.56%	11.26%	10.37%	9.88%	17.31%	15.17%	20.53%	19.00%	17.62%
Value at Risk	9.96%	8.51%	8.59%	7.60%	7.22%	15.53%	11.83%	11.62%	11.22%	10.34%
Expected Shortfall	18.90%	17.34%	18.52%	16.56%	15.68%	28.07%	23.59%	29.68%	27.69%	25.53%
Sharpe Ratio	-0.66	0.65	0.62	0.75	0.74	0.00	0.92	0.57	0.55	0.64
Deutsch Ratio VaR	-0.73	0.81	0.81	1.02	1.02	0.00	1.18	1.02	0.92	1.09
Deutsch Ratio ESf	-0.38	0.40	0.38	0.47	0.47	0.00	0.59	0.40	0.37	0.44

Stand: 31.08.2022

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

# Kontakt

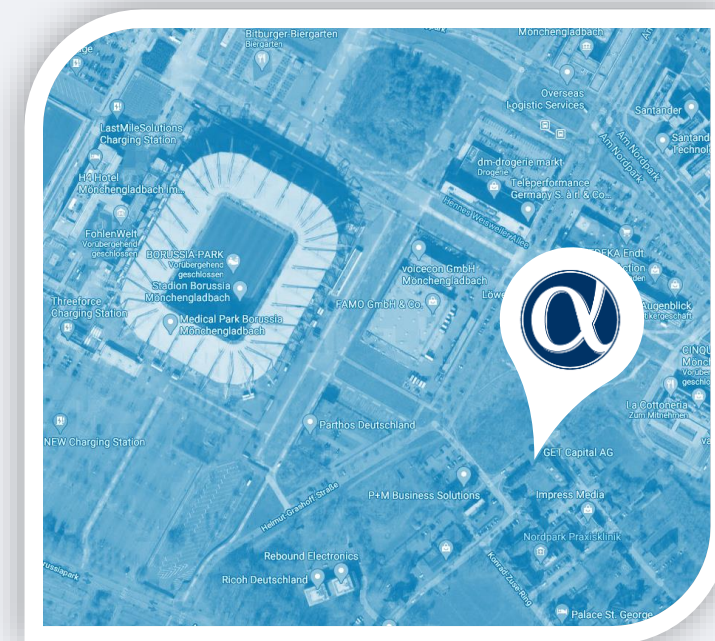


**Harald Schnorrenberg**  
 CEO/ Partner  
 Tel: +49 (0)2161 307 35 22  
 E-Mail: schnorrenberg@get-capital.de



**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.