



# GET Capital ESG Multi Asset

---

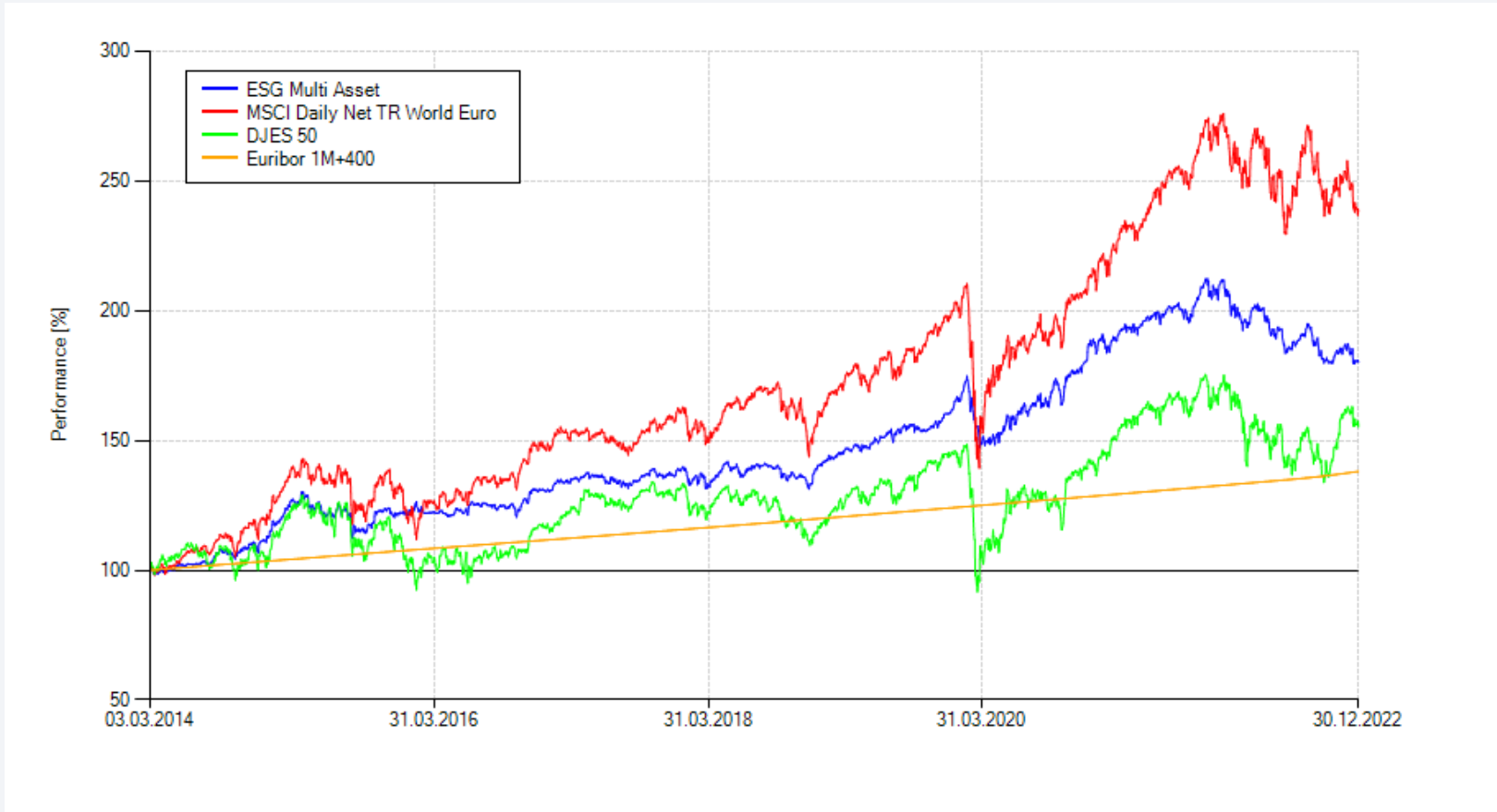
Report Dezember 2022

# 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

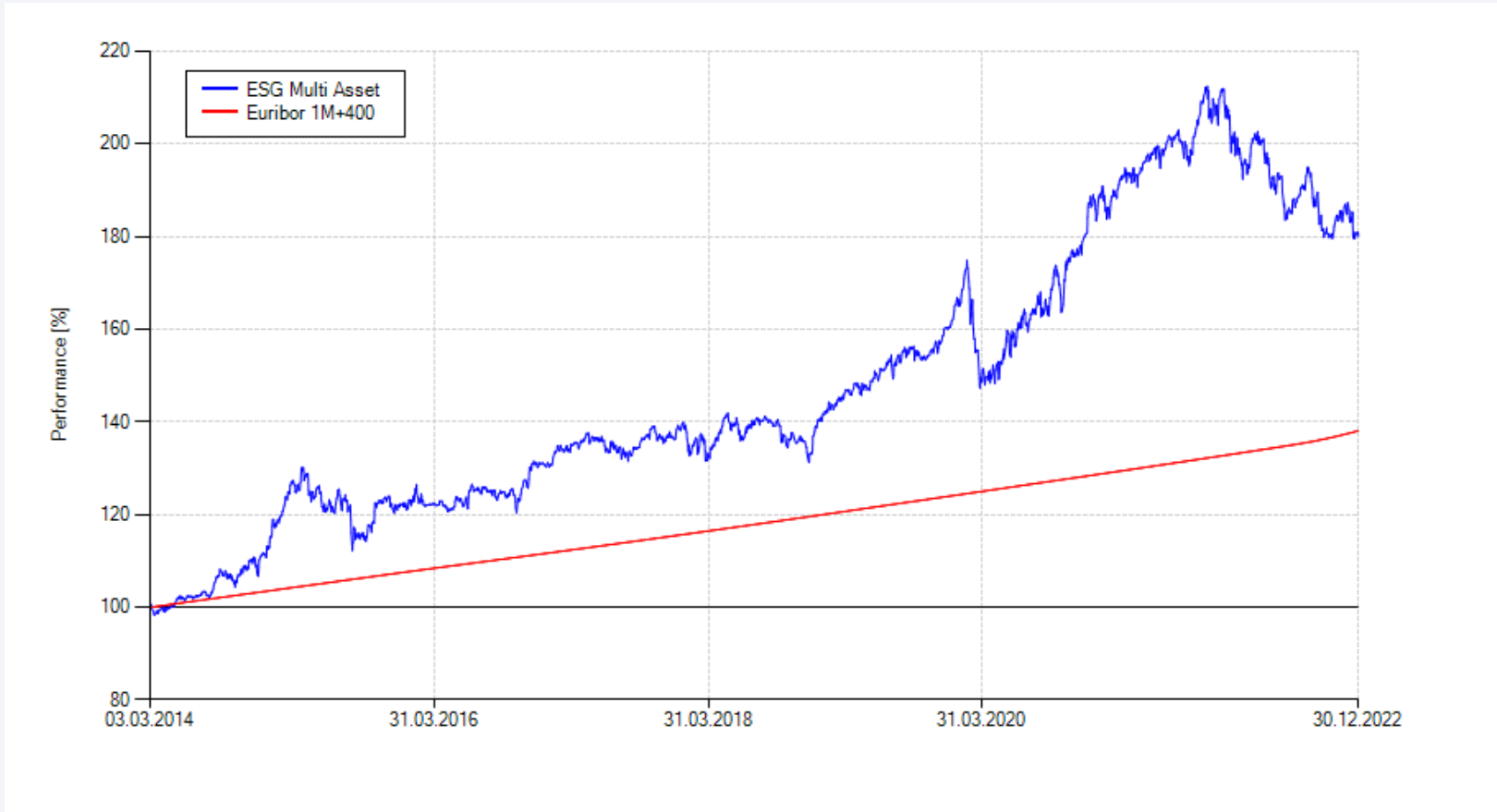
03.03.2014 - 30.12.2022



	Return p.a.	Drawdown
ESG Multi Asset	6.88%	-15.74%
MSCI Daily Net TR World Euro	10.32%	-33.76%
DJES 50	5.10%	-38.24%
Euribor 1M+400	3.72%	0.00%

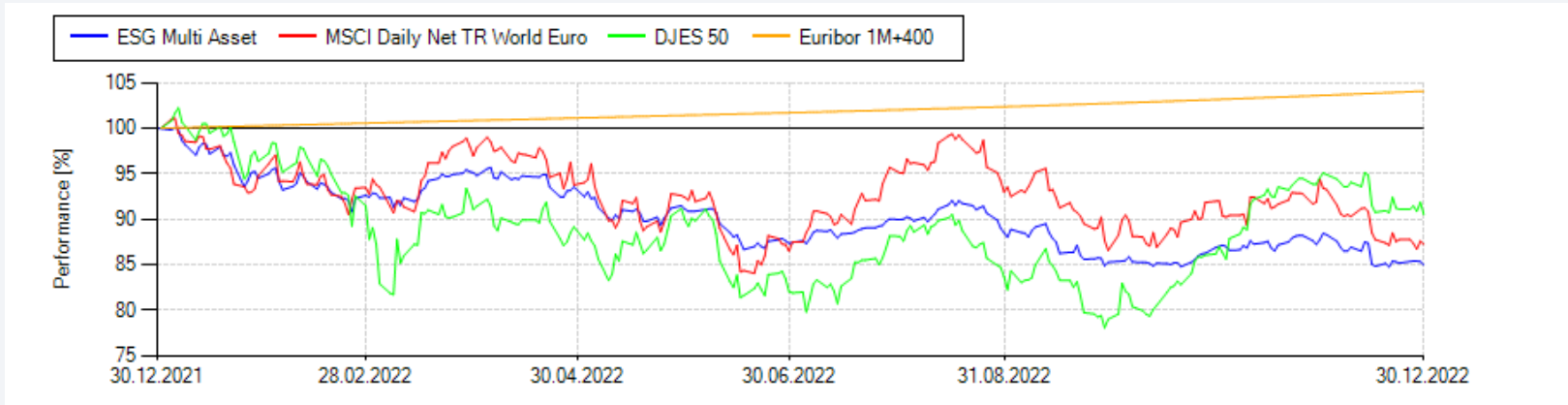
# Performance

03.03.2014 - 30.12.2022

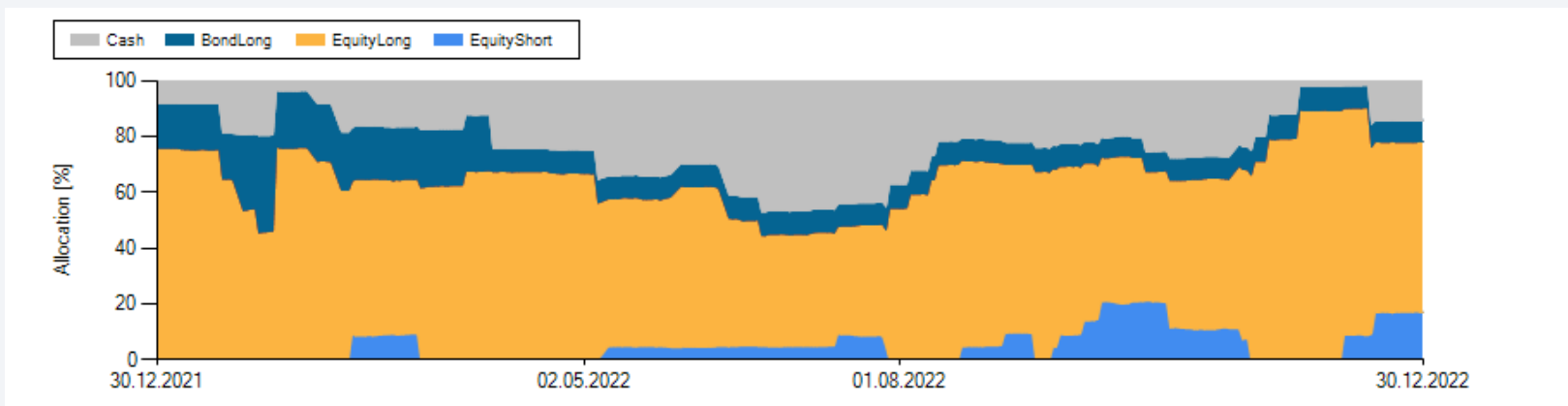


	Return p.a.	Drawdown
ESG Multi Asset	6.88%	-15.74%
Euribor 1M+400	3.72%	0.00%

# Performance Jahr 2022



	Return	Drawdown
ESG Multi Asset	-15.02%	-15.30%
MSCI Daily Net TR World Euro	-12.78%	-16.85%
DJES 50	-9.49%	-23.62%
Euribor 1M+400	4.07%	0.00%



# Performance (Yearly)

03.03.2014 - 30.12.2022

	ESG Multi Asset	MSCI Daily Net TR World Euro	DJES 50	Euribor 1M+400
<b>2022</b>	-15.02%	-12.78%	-9.49%	4.07%
<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: 30.12.2022

# Drawdown (Yearly)

03.03.2014 - 30.12.2022

	ESG Multi Asset	MSCI Daily Net TR World Euro	DJES 50
2022	-15.30%	-16.85%	-23.62%
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: 30.12.2022

# Performance (Monthly) Jahr 2022

	ESG Multi Asset	MSCI Daily Net TR World Euro	DJES 50	Euribor 1M+400
Dez '22	-3.16%	-7.62%	-4.27%	0.46%
Nov '22	0.99%	2.66%	9.70%	0.43%
Okt '22	1.88%	6.24%	9.09%	0.41%
Sep '22	-3.66%	-6.90%	-5.57%	0.37%
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: 30.12.2022



# Drawdown (Monthly) Jahr 2022

	ESG Multi Asset	MSCI Daily Net TR World Euro	DJES 50
Dez '22	-4.18%	-8.15%	-4.85%
Nov '22	-1.28%	-2.94%	-1.57%
Okt '22	-1.27%	-3.91%	-4.37%
Sep '22	-5.14%	-9.42%	-10.02%
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: 30.12.2022

# Performance Annualised 03.03.2014 - 31.12.2022

		ESG Multi Asset	MSCI Daily Net TR World Euro	DJES 50	Euribor 1M+400
<b>YTD*</b>		-15.02%	-12.78%	-9.49%	4.07%
<b>1 Jahr</b>		-15.02%	-12.78%	-9.49%	4.07%
<b>3 Jahre</b>	<b>p.a.</b>	4.01%	6.72%	2.62%	3.67%
<b>5 Jahre</b>		5.73%	8.66%	4.03%	3.65%
<b>7 Jahre</b>		5.70%	8.79%	4.70%	3.65%

\* Stand: 31.12.2022

# Risk Statistics (5 Years) - 30.12.2022

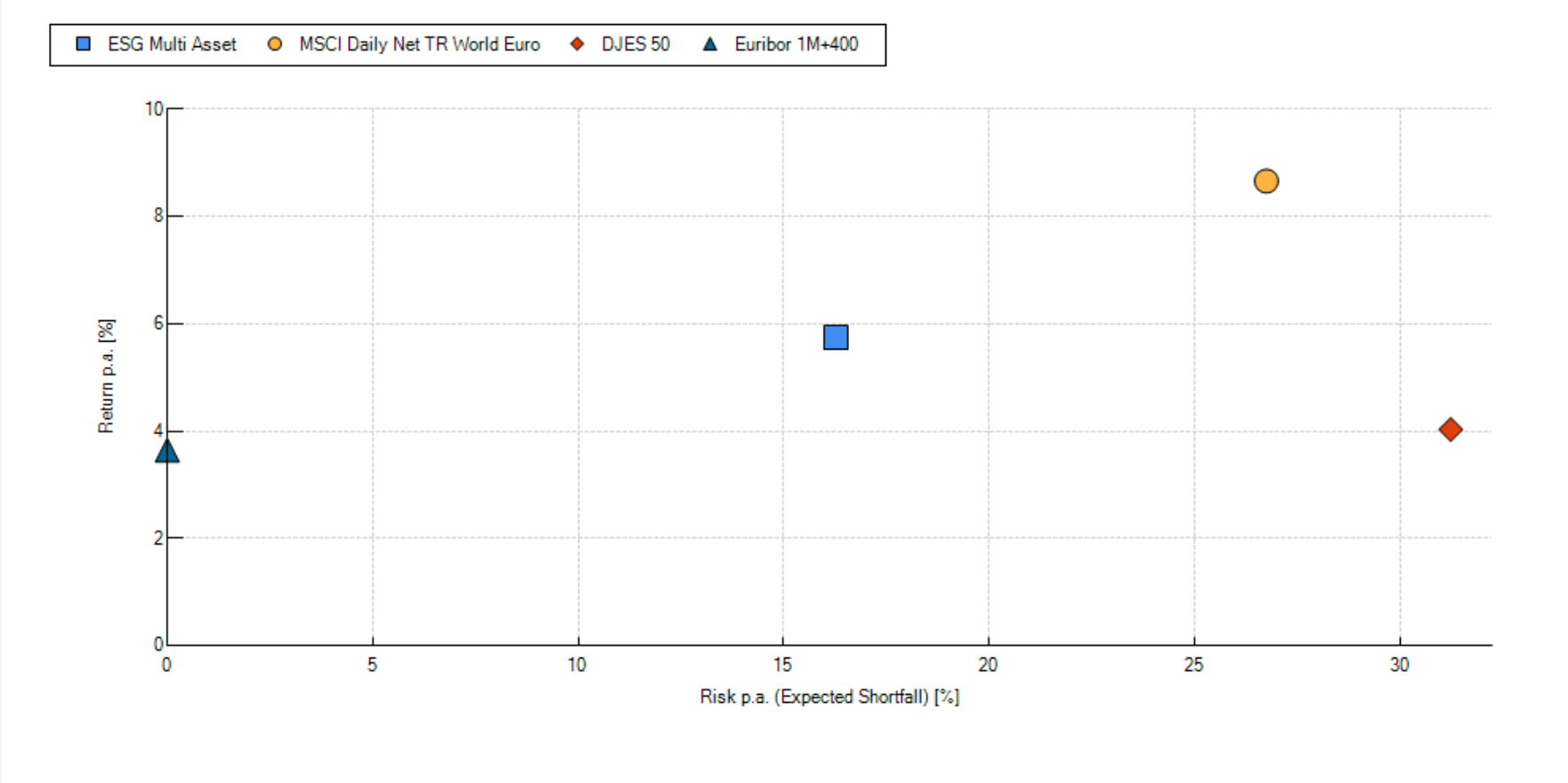
	Ex Post Annualized Data									
	ESG Multi Asset					MSCI Daily Net TR World Euro				
	1	2	3	4	5	1	2	3	4	5
<b>Averaging Years</b>										
<b>Volatility</b>	10.38%	10.08%	11.49%	10.57%	10.11%	18.82%	15.72%	21.21%	19.15%	18.12%
<b>Value at Risk</b>	10.99%	8.59%	9.17%	7.79%	7.72%	17.86%	13.75%	13.97%	11.56%	11.39%
<b>Expected Shortfall</b>	18.63%	17.01%	19.06%	16.96%	16.26%	30.02%	24.73%	31.27%	27.79%	26.75%
<b>Sharpe Ratio</b>	-1.63	0.00	0.38	0.77	0.59	-0.76	0.46	0.32	0.62	0.47
<b>Deutsch Ratio VaR</b>	-1.54	0.01	0.47	1.04	0.78	-0.80	0.52	0.48	1.03	0.75
<b>Deutsch Ratio ESf</b>	-0.91	0.00	0.23	0.48	0.37	-0.47	0.29	0.22	0.43	0.32

Stand: 30.12.2022

Sharpe Ratio =  
Deutsch Ratio =

Excess Return / Volatilität  
Excess Return / Risk of Excess Return

# Return vs. Risk (5 Years) - 30.12.2022



## Kontakt

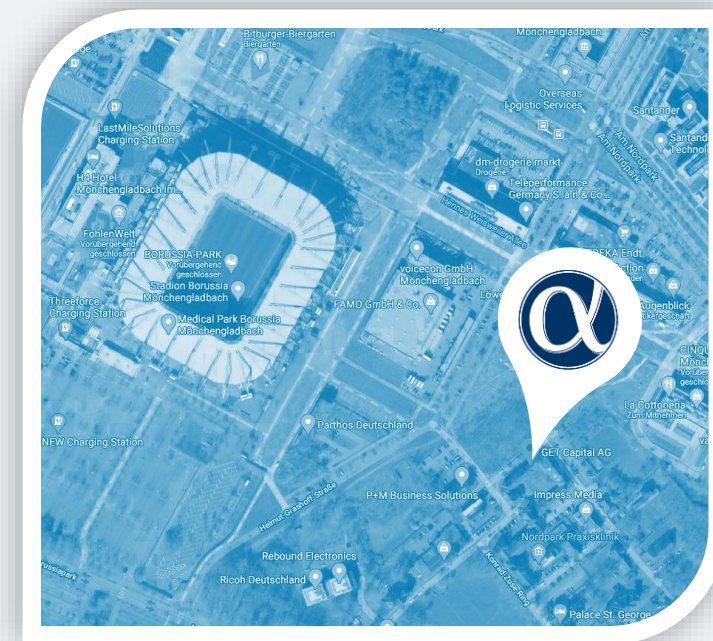


**Harald Schnorrenberg**  
 CEO/ Partner  
 Tel: +49 (0)2161 307 35 22  
 E-Mail: schnorrenberg@get-capital.de



**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.