



# Globale Aktien Quant GET Capital Fonds

Report Dezember 2022



## Globale Aktien Quant GET Capital Fonds – DE000A2P36K7

- Globale aktive Aktienstrategie
- Umsetzungsinstrument: Aktien Einzeltitel und Futures zur Absicherung
- Risikoadjustierter Investment-Ansatz
- Publikumsfonds Auflage 23. Oktober 2012 und Fondsverschmelzung am 17.08.2021
- Einsatz von Modellen der künstlichen Intelligenz (Machine Learning)

# Performance seit Auflage

23.10.2012 - 30.12.2022

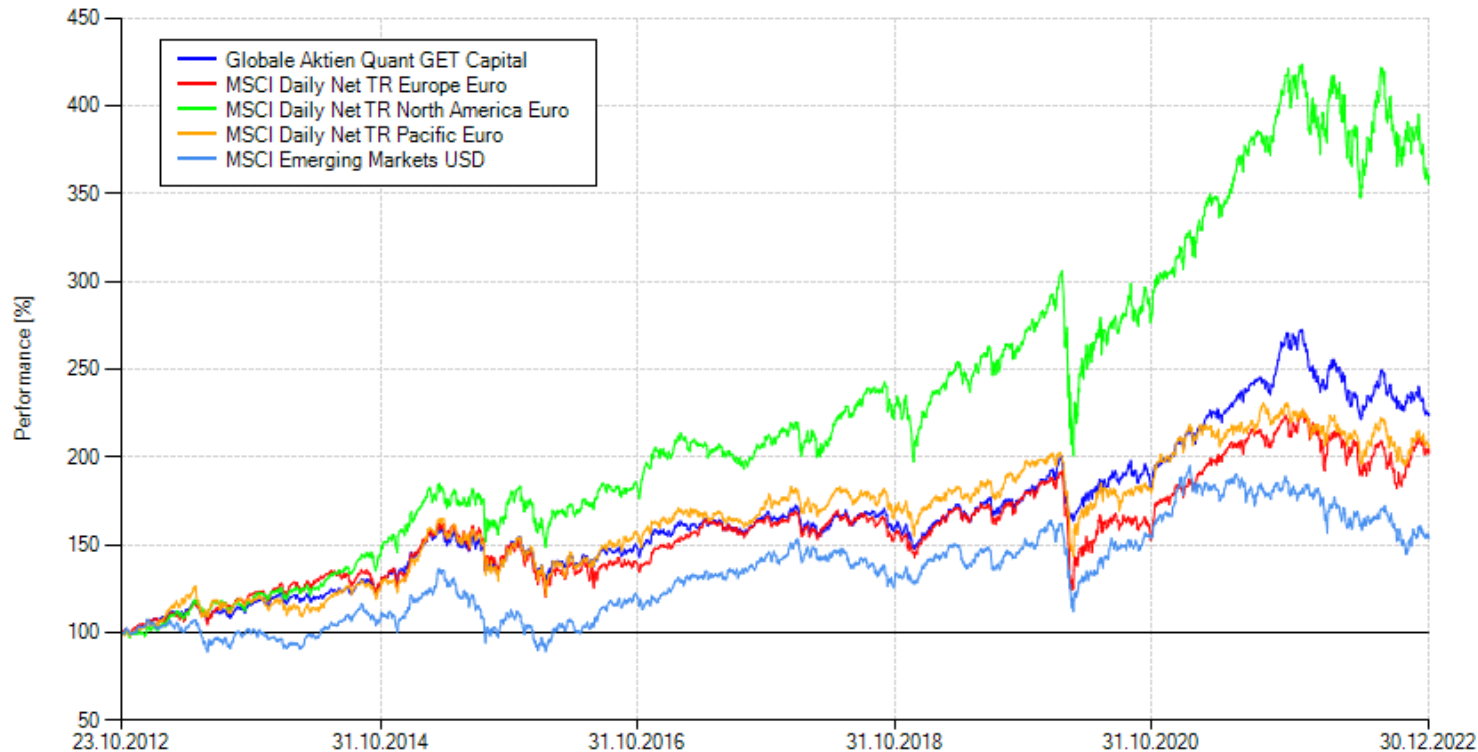


	Return p.a.	Drawdown
Globale Aktien Quant GET Capital	8.23%	-20.14%

\*Publikumsfonds Auflage 23. Oktober 2012 und  
Fondverschmelzung am 17.08.2021

# Performance seit Auflage

23.10.2012 - 30.12.2022



	Return p.a.	Drawdown
Globale Aktien Quant GET Capital	8.23%	-20.14%
MSCI Daily Net TR Europe Euro	7.14%	-35.25%
MSCI Daily Net TR North America Euro	13.36%	-34.37%
MSCI Daily Net TR Pacific Euro	7.39%	-29.20%
MSCI Emerging Markets USD	4.32%	-34.47%

\*Publikumsfonds Auflage 23. Oktober 2012 und Fondsverschmelzung am 17.08.2021

# Performance (Yearly)

23.10.2012 - 30.12.2022

	<b>Globale Aktien Quant GET Capital</b>
<b>2022</b>	-17.51%
<b>2021</b>	34.53%
<b>2020</b>	8.12%
<b>2019</b>	24.54%
<b>2018</b>	-9.52%
<b>2017</b>	6.19%
<b>2016</b>	5.68%
<b>2015</b>	8.68%
<b>2014</b>	13.03%
<b>2013</b>	16.15%
<b>2012</b>	3.44%

\* Stand: 30.12.2022

\*Publikumsfonds Auflage 23. Oktober 2012 und  
Fondverschmelzung am 17.08.2021

# Drawdown (Yearly) 23.10.2012 - 30.12.2022

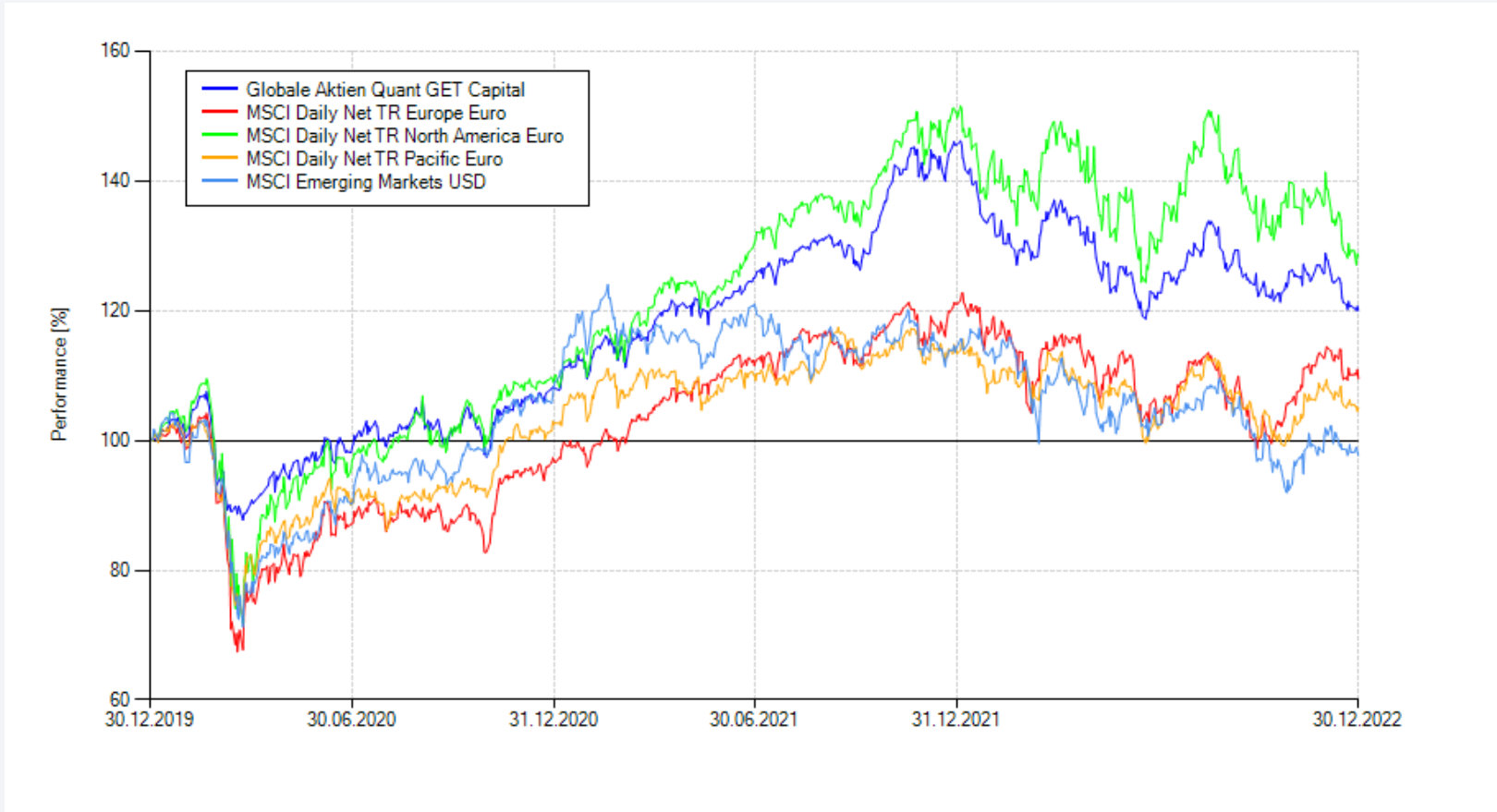
	<b>Globale Aktien Quant GET Capital</b>
<b>2022</b>	-18.76%
<b>2021</b>	-4.19%
<b>2020</b>	-18.38%
<b>2019</b>	-6.07%
<b>2018</b>	-14.53%
<b>2017</b>	-5.73%
<b>2016</b>	-13.01%
<b>2015</b>	-17.27%
<b>2014</b>	-6.93%
<b>2013</b>	-9.44%
<b>2012</b>	-2.12%

\*Publikumsfonds Auflage 23. Oktober 2012 und  
Fondsverschmelzung am 17.08.2021

\* Stand: 30.12.2022

# Performance seit 2020

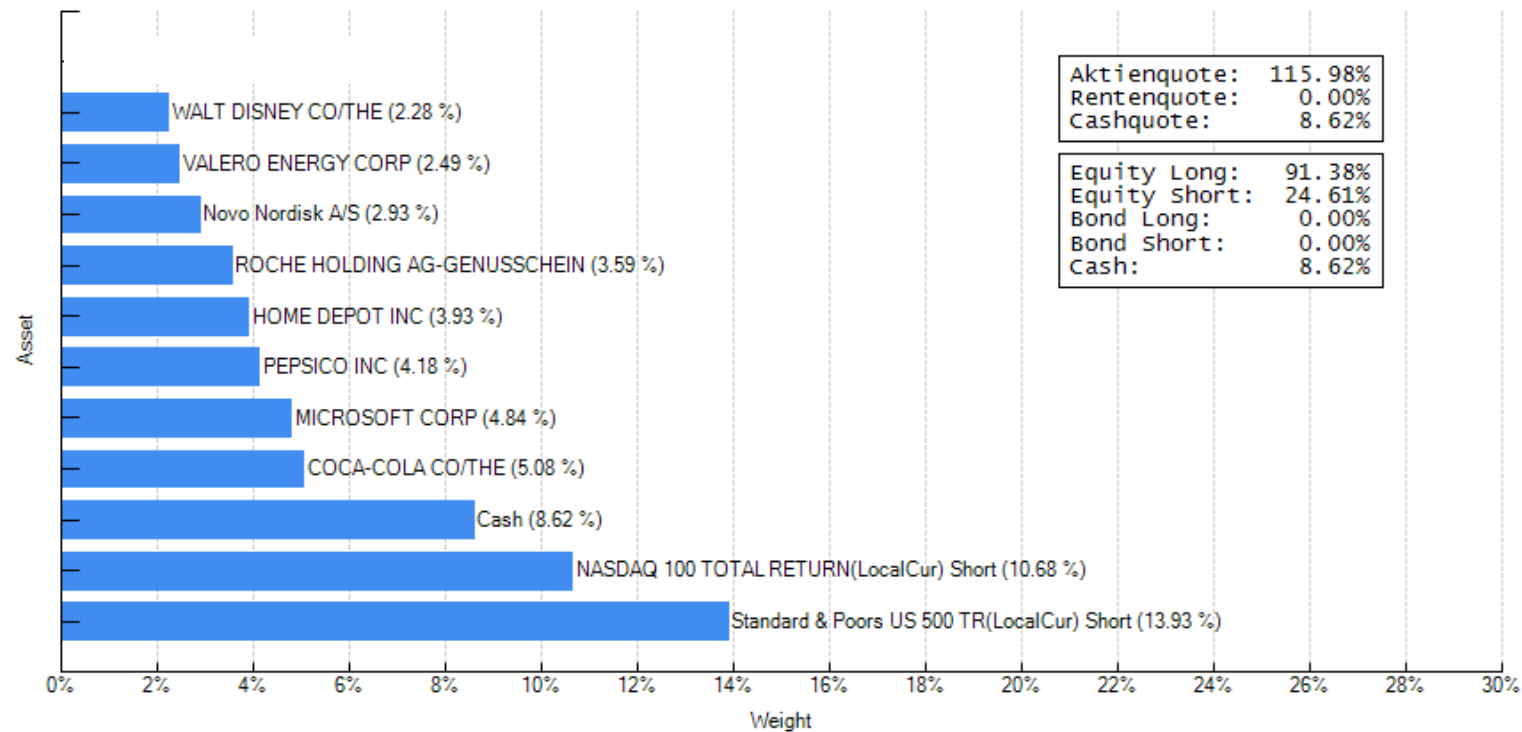
31.12.2019 - 30.12.2022



	Return p.a.	Drawdown
Globale Aktien Quant GET Capital	6.26%	-18.76%
MSCI Daily Net TR Europe Euro	3.07%	-35.25%
MSCI Daily Net TR North America Euro	8.68%	-34.37%
MSCI Daily Net TR Pacific Euro	1.66%	-29.20%
MSCI Emerging Markets USD	-0.77%	-31.62%

# Allocation Quota (Day) Top 10

30.12.2022





# Risk Statistics (5 Years) - 30.12.2022

	Ex Post Annualized Data				
	Globale Aktien Quant GET Capital				
Averaging Years	1	2	3	4	5
Volatility	14.03%	13.02%	14.42%	13.71%	13.54%
Value at Risk	14.34%	12.17%	12.26%	11.13%	11.63%
Expected Shortfall	22.81%	20.43%	22.91%	21.58%	21.79%
Sharpe Ratio	-1.43	0.43	0.45	0.78	0.49
Deutsch Ratio VaR	-1.39	0.46	0.53	0.97	0.56
Deutsch Ratio ESf	-0.88	0.27	0.29	0.50	0.30

Stand: 30.12.2022

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

# Performance Annualised 23.10.2012 - 30.12.2022

		Globale Aktien Quant GET Capital
YTD*		-17.51%
1 Jahr		-17.51%
3 Jahre	p.a.	6.26%
5 Jahre		6.21%
7 Jahre		6.14%
10 Jahre		8.03%

\*Publikumsfonds Auflage 23. Oktober 2012 und  
Fondverschmelzung am 17.08.2021

\* Stand: 30.12.2022

# Kontakt

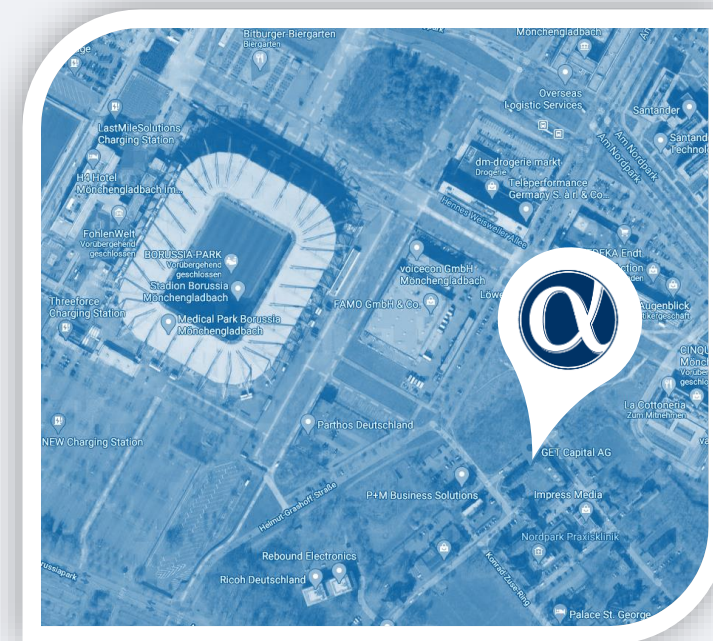


**Harald Schnorrenberg**  
 CEO/ Partner  
 Tel: +49 (0)2161 307 35 22  
 E-Mail: schnorrenberg@get-capital.de



**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.