



# Globale Aktien Quant GET Capital Fonds

Report Februar 2023

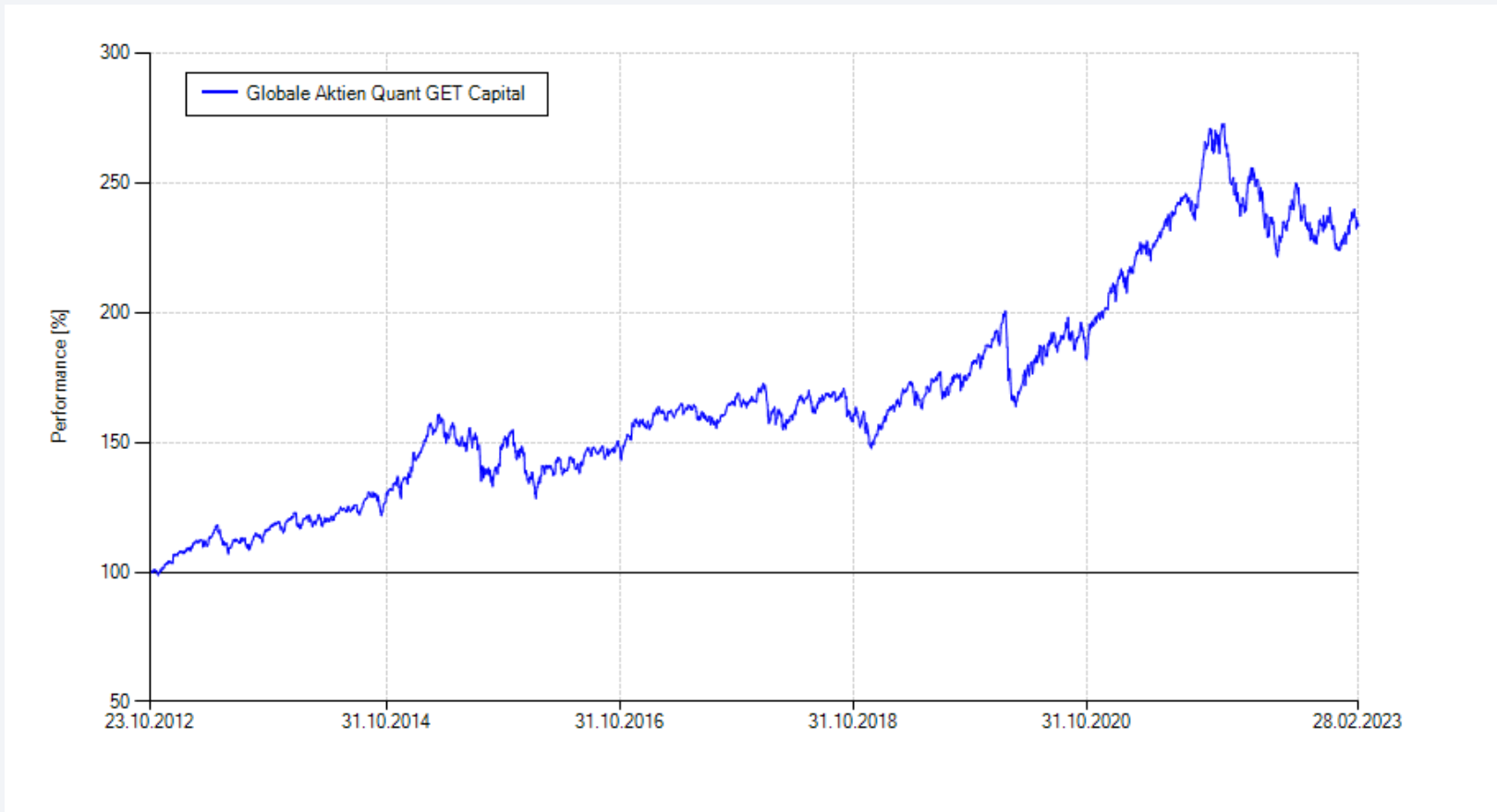


## Globale Aktien Quant GET Capital Fonds – DE000A2P36K7

- 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 - 28.02.2023

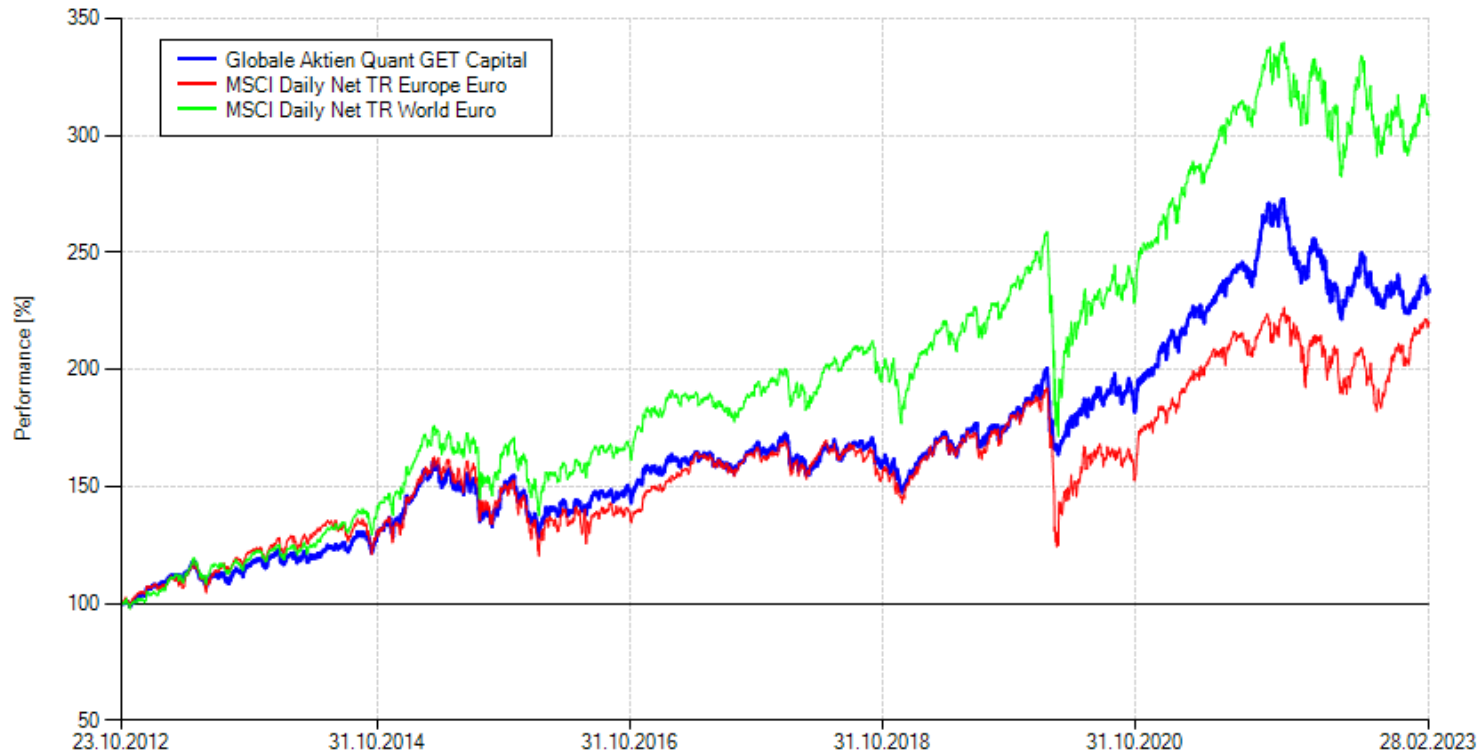


	Return p.a.	Drawdown
Globale Aktien Quant GET Capital	8.52%	-20.14%

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

# Performance seit Auflage

23.10.2012 - 28.02.2023

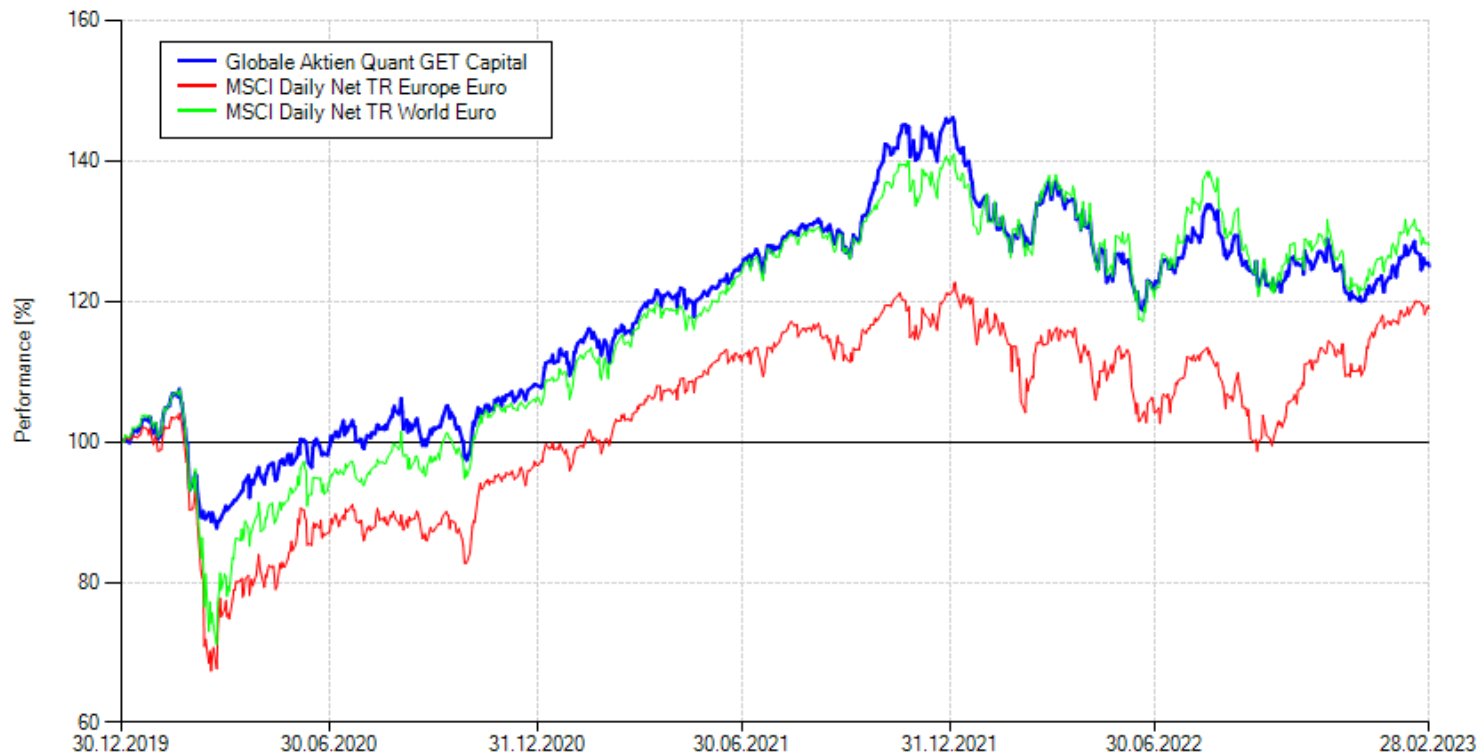


	Return p.a.	Drawdown
Globale Aktien Quant GET Capital	8.52%	-20.14%
MSCI Daily Net TR Europe Euro	7.89%	-35.25%
MSCI Daily Net TR World Euro	11.49%	-33.76%

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

# Performance seit Jahr 2020

30.12.2019 - 28.02.2023



	Return p.a.	Drawdown
Globale Aktien Quant GET Capital	7.29%	-18.76%
MSCI Daily Net TR Europe Euro	5.62%	-35.25%
MSCI Daily Net TR World Euro	8.07%	-33.76%

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

# Performance (Yearly) 23.10.2012 - 28.02.2023

	Globale Aktien Quant GET Capital	MSCI Daily Net TR Europe Euro	MSCI Daily Net TR World Euro
<b>2023</b>	4.15%	8.69%	5.17%
<b>2022</b>	-17.51%	-9.49%	-12.78%
<b>2021</b>	34.53%	25.13%	31.07%
<b>2020</b>	8.12%	-3.32%	6.33%
<b>2019</b>	24.54%	26.05%	30.02%
<b>2018</b>	-9.52%	-10.57%	-4.11%
<b>2017</b>	6.19%	10.24%	7.51%
<b>2016</b>	5.68%	2.58%	10.73%
<b>2015</b>	8.68%	8.22%	10.42%
<b>2014</b>	13.03%	6.84%	19.50%
<b>2013</b>	16.15%	19.82%	21.20%
<b>2012</b>	3.44%	4.47%	1.60%

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

\* Stand: 28.02.2023

# Drawdown (Yearly) 23.10.2012 - 28.02.2023

	Globale Aktien Quant GET Capital	MSCI Daily Net TR Europe Euro	MSCI Daily Net TR World Euro
<b>2023</b>	-3.14%	-1.63%	-2.87%
<b>2022</b>	-18.76%	-19.52%	-16.85%
<b>2021</b>	-4.19%	-5.47%	-4.61%
<b>2020</b>	-18.38%	-35.25%	-33.76%
<b>2019</b>	-6.07%	-6.87%	-5.98%
<b>2018</b>	-14.53%	-15.86%	-16.61%
<b>2017</b>	-5.73%	-6.23%	-7.00%
<b>2016</b>	-13.01%	-16.76%	-15.27%
<b>2015</b>	-17.27%	-17.60%	-17.70%
<b>2014</b>	-6.93%	-11.08%	-7.94%
<b>2013</b>	-9.44%	-11.04%	-9.26%
<b>2012</b>	-2.12%	-4.23%	-4.20%

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

\* Stand: 28.02.2023

# Performance Annualised 23.10.2012 - 28.02.2023

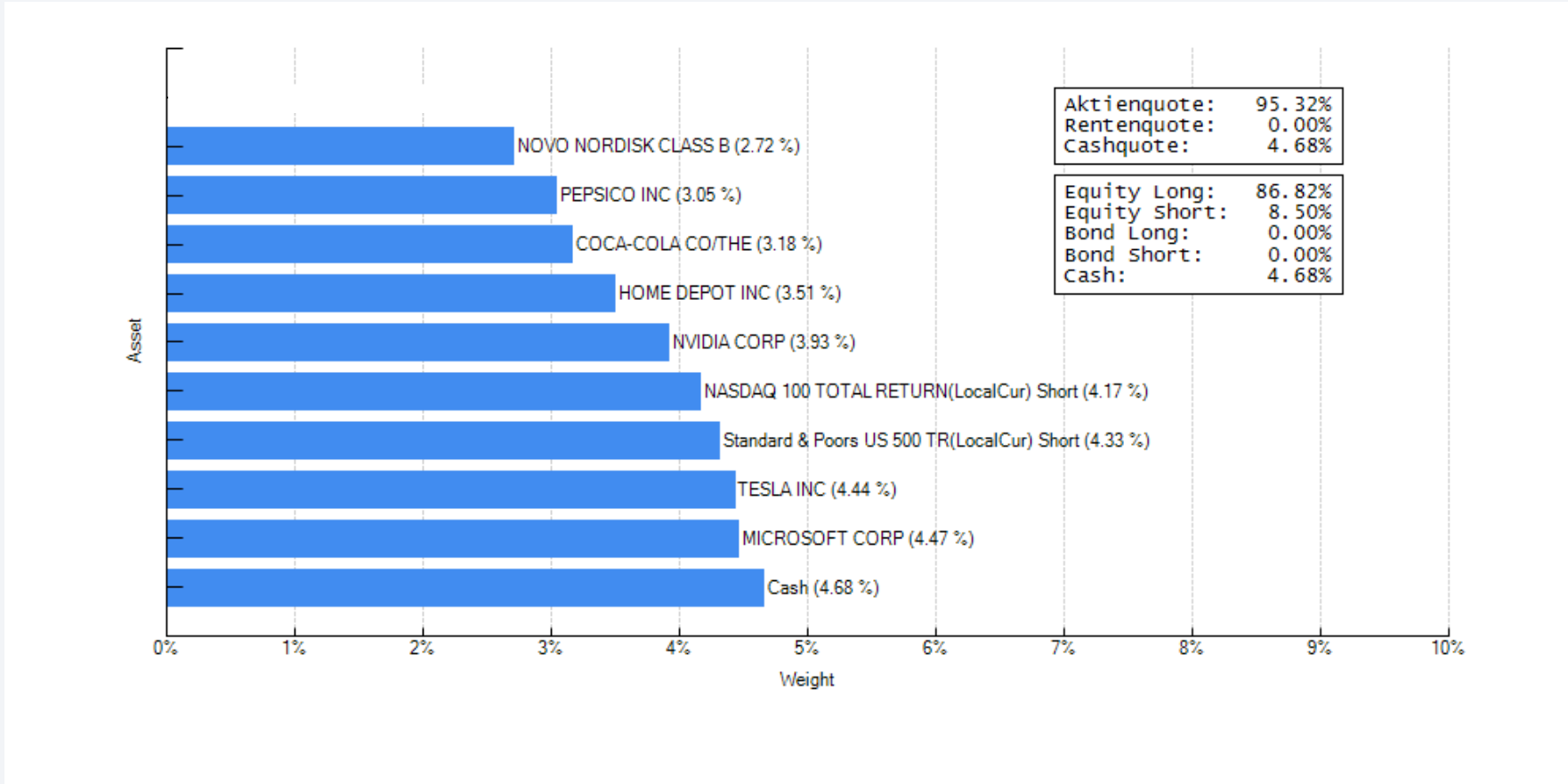
		Globale Aktien Quant GET Capital
YTD*		4.15%
1 Jahr		-3.48%
3 Jahre	p.a.	10.29%
5 Jahre		7.43%
7 Jahre		7.86%
10 Jahre		7.83%

\* Stand: 28.02.2023



# Allocation Quota (Day) Top 10

28.02.2023



# Risk Statistics (5 Years) - 28.02.2023

		Ex Post Annualized Data									
		Globale Aktien Quant GET Capital					MSCI Daily Net TR World Euro				
Averaging Years		1	2	3	4	5	1	2	3	4	5
<b>Volatility</b>		13.77%	12.91%	13.89%	13.76%	13.44%	18.20%	15.58%	20.92%	19.15%	18.06%
<b>Value at Risk</b>		13.60%	12.14%	12.17%	11.38%	11.55%	16.77%	13.76%	13.81%	11.83%	11.55%
<b>Expected Shortfall</b>		21.59%	20.29%	21.61%	21.74%	21.54%	28.31%	24.31%	30.08%	27.84%	26.56%
<b>Sharpe Ratio</b>		-0.29	0.43	0.74	0.69	0.57	-0.12	0.52	0.51	0.53	0.53
<b>Deutsch Ratio VaR</b>		-0.30	0.46	0.85	0.84	0.67	-0.13	0.59	0.78	0.86	0.84
<b>Deutsch Ratio ESf</b>		-0.19	0.27	0.48	0.44	0.36	-0.08	0.33	0.36	0.37	0.36

Stand: 28.02.2023

Sharpe Ratio = Excess Return / Volatilität  
 Deutsch Ratio = Excess Return / Risk of Excess Return

# Kontakt

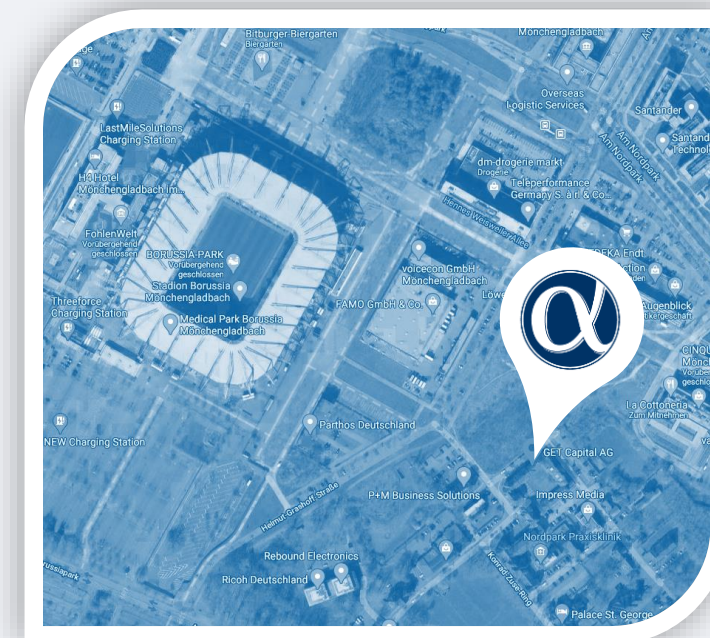


**Harald Schnorrenberg**  
 CEO/ Partner  
 Tel: +49 (0)2161 307 35 22  
 E-Mail: schnorrenberg@get-capital.de



**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.