

GET Capital ESG Multi Asset

Report Oktober 2023

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 – 31.10.2023

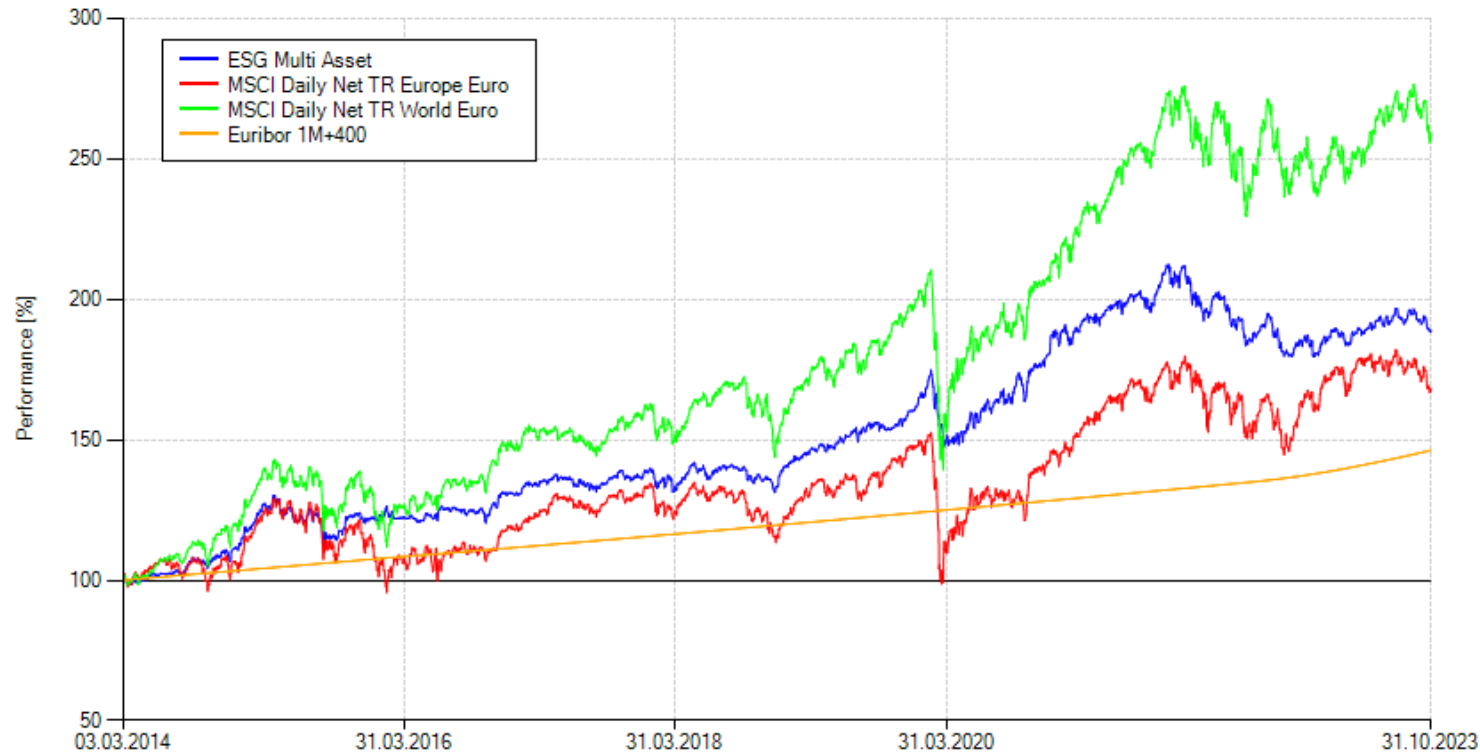


	Return p.a.	Drawdown
ESG Multi Asset	6.81%	-15.74%
Euribor 1M+400	4.01%	0.00%



Performance

03.03.2014 – 31.10.2023

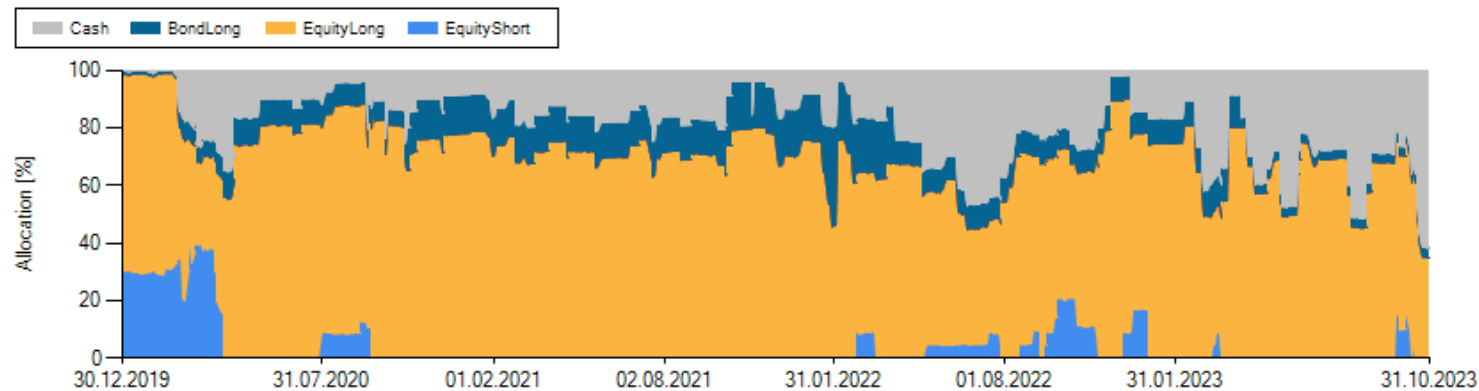


	Return p.a.	Drawdown
ESG Multi Asset	6.81%	-15.74%
MSCI Daily Net TR Europe Euro	5.53%	-35.25%
MSCI Daily Net TR World Euro	10.36%	-33.76%
Euribor 1M+400	4.01%	0.00%



Performance

03.03.2014 - 31.10.2023



	Return p.a.	Drawdown
ESG Multi Asset	4.46%	-15.74%
MSCI Daily Net TR Europe Euro	3.66%	-35.25%
MSCI Daily Net TR World Euro	7.60%	-33.76%
Euribor 1M+400	4.41%	0.00%



Performance (Yearly)

03.03.2014 – 31.10.2023

	ESG Multi Asset	MSCI Daily Net TR World Euro	Euribor 1M+400
2023	5.06%	8.93%	5.91%
2022	-15.02%	-12.78%	4.07%
2021	17.39%	31.07%	3.44%
2020	12.82%	6.33%	3.50%
2019	19.93%	30.02%	3.60%
2018	-2.07%	-4.11%	3.65%
2017	4.66%	7.51%	3.62%
2016	6.61%	10.73%	3.65%
2015	9.52%	10.42%	3.93%
2014	11.43%	19.54%	3.40%

* Stand: 31.10.2023



Drawdown (Yearly)

03.03.2014 – 31.10.2023

	ESG Multi Asset	MSCI Daily Net TR World Euro
2023	-4.24%	-7.53%
2022	-15.30%	-16.85%
2021	-3.92%	-4.61%
2020	-15.74%	-33.76%
2019	-3.36%	-5.98%
2018	-7.48%	-16.61%
2017	-4.43%	-7.00%
2016	-4.85%	-15.27%
2015	-13.76%	-17.70%
2014	-3.71%	-7.94%

* Stand: 31.10.2023



Performance Annualised

03.03.2014 – 31.10.2023

		ESG Multi Asset	MSCI Daily Net TR Europe Euro
YTD*		5.06%	4.94%
1 Jahr		2.76%	8.22%
3 Jahre	p.a.	4.87%	11.49%
5 Jahre		6.74%	6.28%
7 Jahre		6.20%	6.24%

* Stand: 31.10.2023



Risk Statistics (5 Years)

03.03.2014 – 31.10.2023

Averaging Years	Ex Post Annualized Data									
	ESG Multi Asset					MSCI Daily Net TR World Euro				
	1	2	3	4	5	1	2	3	4	5
Volatility	7.41%	9.34%	9.28%	10.49%	9.90%	12.61%	15.83%	14.44%	19.17%	18.05%
Value at Risk	6.61%	8.03%	7.60%	7.82%	7.31%	13.41%	15.28%	12.34%	13.09%	12.09%
Expected Shortfall	11.38%	15.73%	14.88%	16.94%	15.64%	19.21%	24.65%	22.05%	27.74%	26.28%
Sharpe Ratio	0.10	-0.56	0.48	0.49	0.67	0.09	-0.10	0.73	0.42	0.51
Deutsch Ratio VaR	0.11	-0.65	0.58	0.66	0.90	0.09	-0.11	0.86	0.61	0.76
Deutsch Ratio ESf	0.07	-0.33	0.30	0.30	0.42	0.06	-0.07	0.48	0.29	0.35

Stand: 31.10.2023

Sharpe Ratio = Excess Return / Volatilität

Deutsch Ratio = Excess Return / Risk of Excess Return



KONTAKT



Harald Schnorrenberg

+49 2161 30735 – 22

schnorrenberg@get-capital.de

www.get-capital.de



Marco Wunderlich

+49 2161 30735 – 12

wunderlich@get-capital.de

www.get-capital.de

Mönchengladbach

Heinz-Nixdorf-Straße 31

41179 Mönchengladbach

Düsseldorf

Schulstraße 2

40213 Düsseldorf

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.