

Globale Aktien Quant GET Capital Fonds

Report Oktober 2023

Globale Aktien Quant GET Capital Fonds

ISIN 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 - 31.10.2023



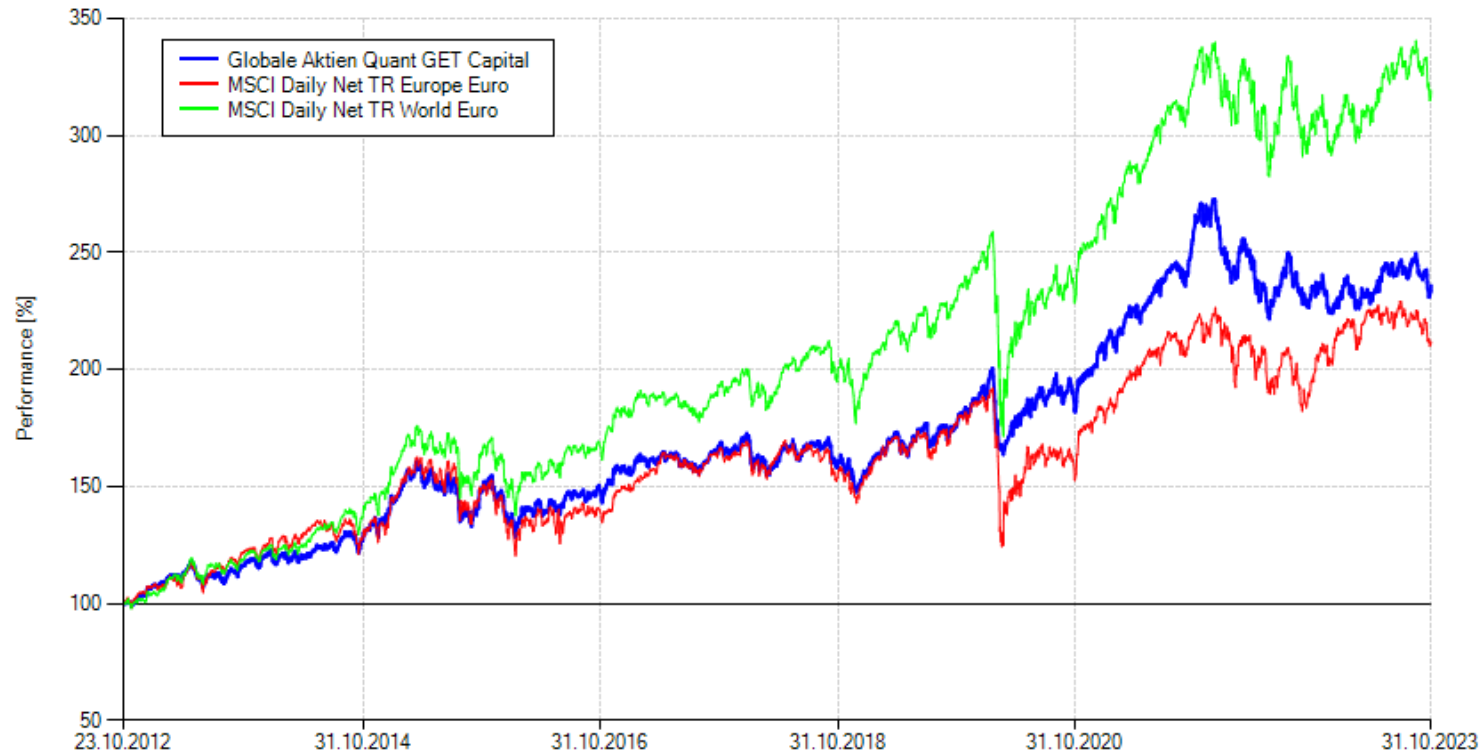
	Return p.a.	Drawdown
Globale Aktien Quant GET Capital	8.09%	-20.14%

*Publikumsfonds Auflage 23. Oktober 2012 und
Fondsverschmelzung am 17.08.2021



Performance seit Auflage

23.10.2012 – 31.10.2023



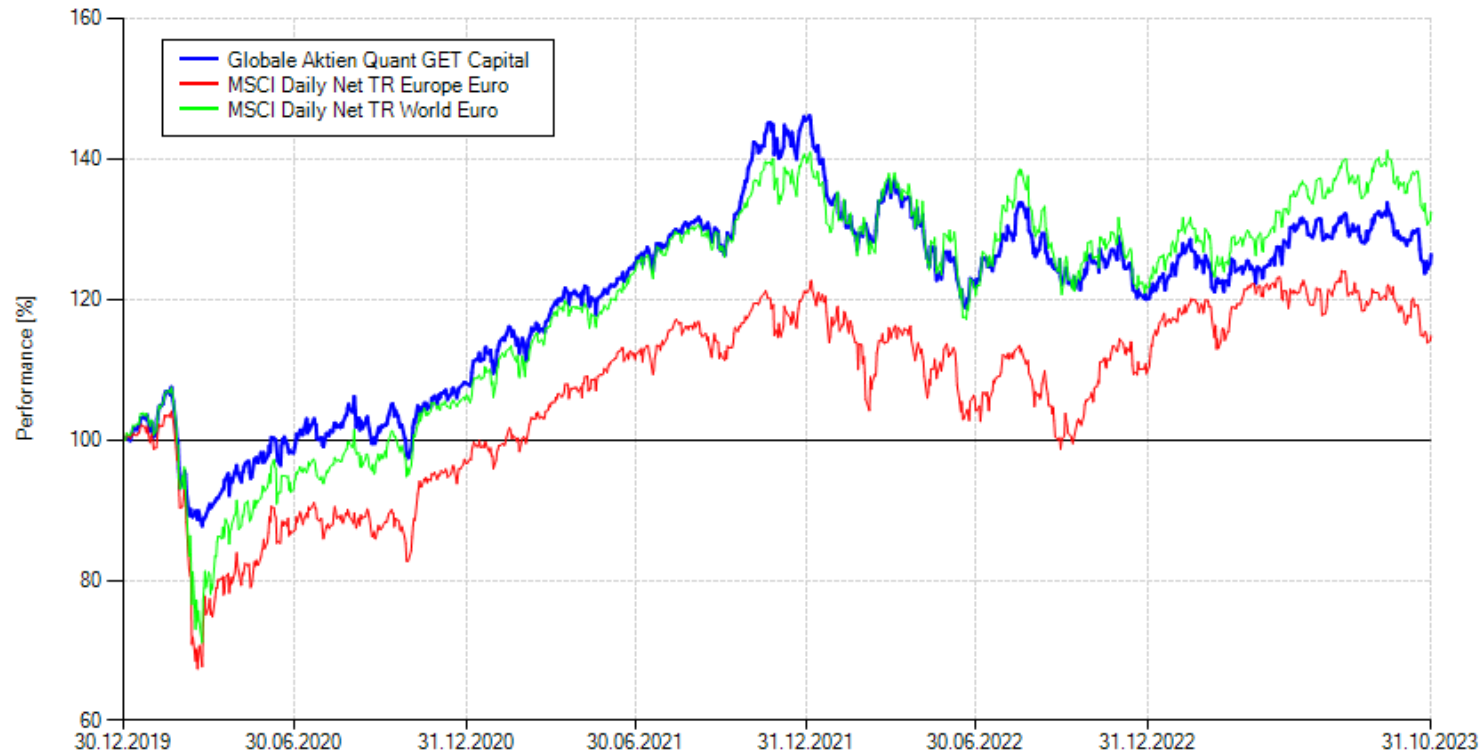
	Return p.a.	Drawdown
Globale Aktien Quant GET Capital	8.09%	-20.14%
MSCI Daily Net TR Europe Euro	7.05%	-35.25%
MSCI Daily Net TR World Euro	11.10%	-33.76%

*Publikumsfonds Auflage 23. Oktober 2012 und Fondsverschmelzung am 17.08.2021



Performance seit 2020

30.12.2019 - 31.10.2023



	Return p.a.	Drawdown
Globale Aktien Quant GET Capital	6.29%	-18.76%
MSCI Daily Net TR Europe Euro	3.66%	-35.25%
MSCI Daily Net TR World Euro	7.60%	-33.76%

*Publikumsfonds Auflage 23. Oktober 2012 und Fondsverschmelzung am 17.08.2021



Performance (Yearly)

23.10.2012 - 31.10.2023

	Globale Aktien Quant GET Capital	MSCI Daily Net TR Europe Euro	MSCI Daily Net TR World Euro
2023	5.33%	4.94%	8.93%
2022	-17.51%	-9.49%	-12.78%
2021	34.53%	25.13%	31.07%
2020	8.12%	-3.32%	6.33%
2019	24.54%	26.05%	30.02%
2018	-9.52%	-10.57%	-4.11%
2017	6.19%	10.24%	7.51%
2016	5.68%	2.58%	10.73%
2015	8.68%	8.22%	10.42%
2014	13.03%	6.84%	19.50%
2013	16.15%	19.82%	21.20%
2012	3.44%	4.47%	1.60%

*Publikumsfonds Auflage 23. Oktober 2012 und
Fondsverschmelzung am 17.08.2021

* Stand: 31.10.2023



Drawdown (Yearly)

23.10.2012 – 31.10.2023

	Globale Aktien Quant GET Capital	MSCI Daily Net TR Europe Euro	MSCI Daily Net TR World Euro
2023	-7.50%	-8.31%	-7.53%
2022	-18.76%	-19.52%	-16.85%
2021	-4.19%	-5.47%	-4.61%
2020	-18.38%	-35.25%	-33.76%
2019	-6.07%	-6.87%	-5.98%
2018	-14.53%	-15.86%	-16.61%
2017	-5.73%	-6.23%	-7.00%
2016	-13.01%	-16.76%	-15.27%
2015	-17.27%	-17.60%	-17.70%
2014	-6.93%	-11.08%	-7.94%
2013	-9.44%	-11.04%	-9.26%
2012	-2.12%	-4.23%	-4.20%

*Publikumsfonds Auflage 23. Oktober 2012 und
Fondsverschmelzung am 17.08.2021

* Stand: 31.10.2023



Performance Annualised

23.10.2012 – 31.10.2023

		Globale Aktien Quant GET Capital
YTD*		5.33%
1 Jahr		0.07%
3 Jahre	p.a.	9.06%
5 Jahre		7.95%
7 Jahre		6.89%
10 Jahre		7.24%

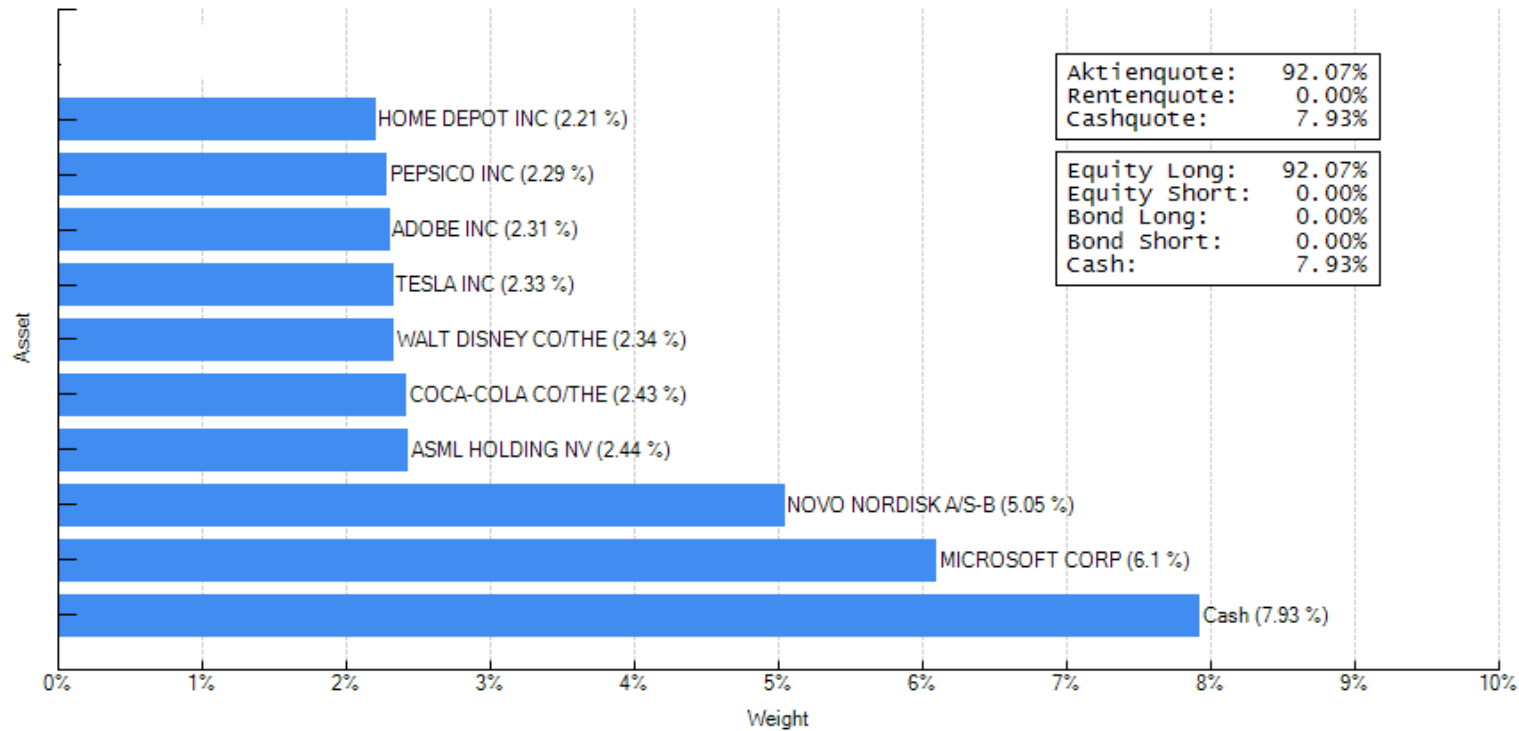
*Publikumsfonds Auflage 23. Oktober 2012 und
Fondverschmelzung am 17.08.2021

* Stand: 31.10.2023



Allocation Quota (Day) Top 10

31.10.2023



Risk Statistics (5 Years)

23.10.2012 – 31.10.2023

Averaging Years	Ex Post Annualized Data									
	Globale Aktien Quant GET Capital					MSCI Daily Net TR World Euro				
	1	2	3	4	5	1	2	3	4	5
Volatility	11.17%	12.83%	12.38%	13.57%	13.28%	12.61%	15.83%	14.44%	19.17%	18.05%
Value at Risk	12.19%	13.13%	11.69%	12.12%	11.52%	13.41%	15.28%	12.34%	13.09%	12.09%
Expected Shortfall	16.99%	20.10%	18.98%	21.19%	20.97%	19.21%	24.65%	22.05%	27.74%	26.28%
Sharpe Ratio	-0.18	-0.45	0.69	0.55	0.59	0.09	-0.10	0.73	0.42	0.51
Deutsch Ratio VaR	-0.16	-0.44	0.73	0.61	0.68	0.09	-0.11	0.86	0.61	0.76
Deutsch Ratio ESf	-0.12	-0.28	0.45	0.35	0.37	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

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.