

Globale Aktien Quant GET Capital Fonds

Report Februar 2024

Globale Aktien Quant GET Capital Fonds

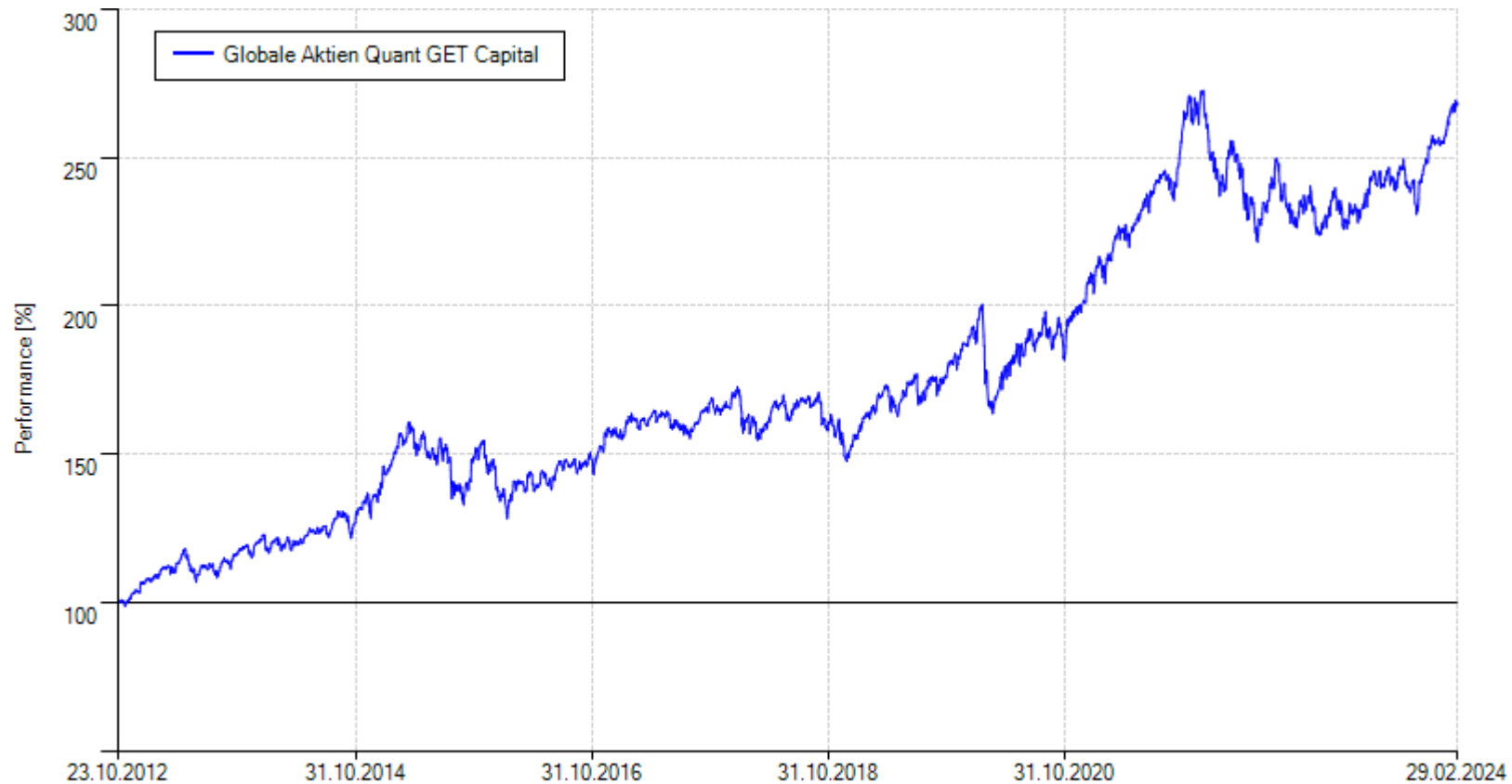
ISIN DE000A2P36K7

- Globale aktive Aktienstrategie
- Umsetzungsinstrument: Aktien Einzeltitel und Futures zur Absicherung
- Risikoadjustierter Investment-Ansatz
- Publikumsfonds Auflage 23. Oktober 2012 in Luxembourg, Übertrag / Neu-Auflage in Deutschland mit gleichem Ansatz 15. März 2021
- Einsatz von Modellen der künstlichen Intelligenz (Machine Learning)



Performance

23.10.2012 - 29.02.2024



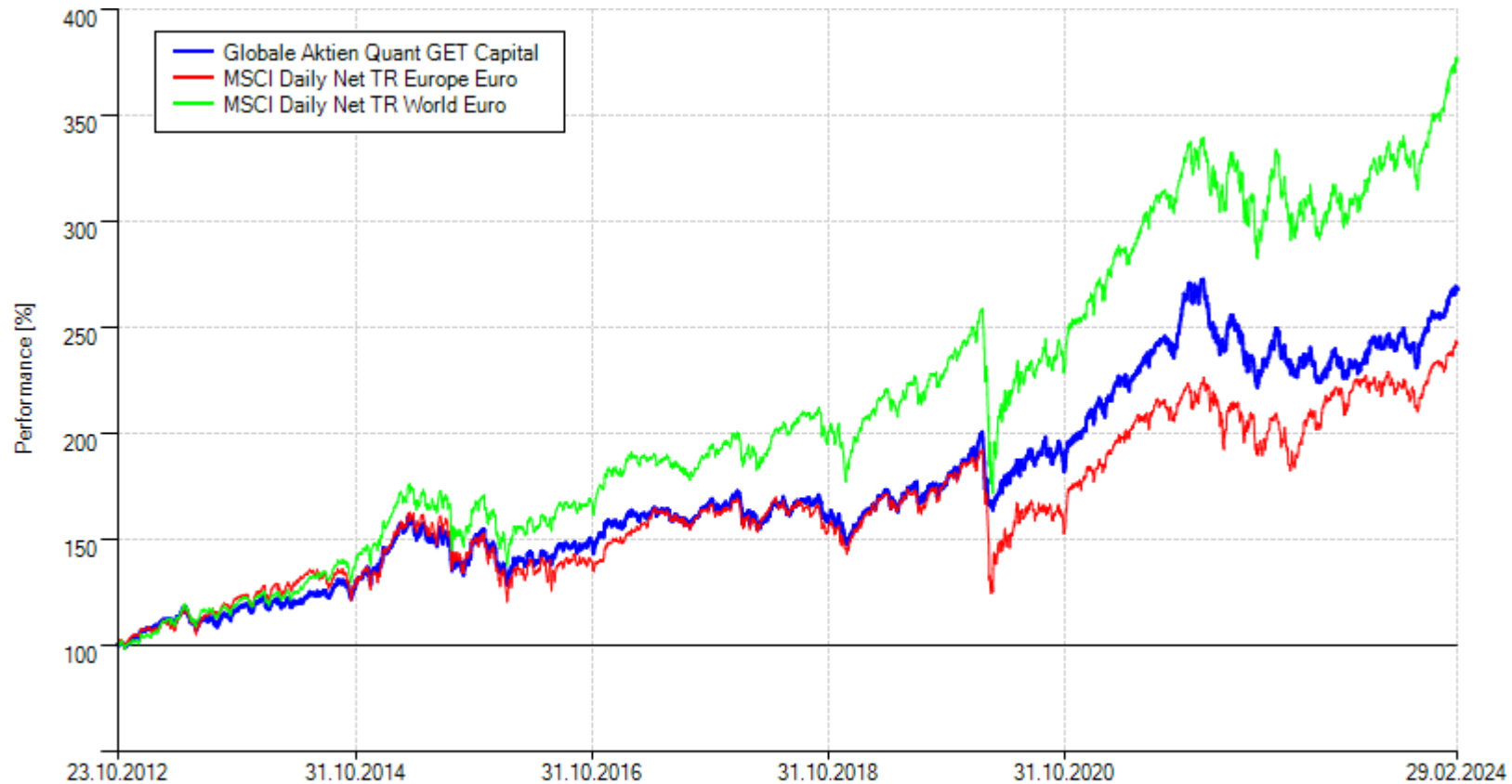
| | Return p.a. | Drawdown |
|---|--------------|----------------|
| Globale Aktien Quant GET Capital | 9.09% | -20.14% |

*
Publikumsfonds Auflage 23. Oktober 2012 in
Luxembourg, Übertrag / Neu Auflage in Deutschland
mit gleichem Ansatz 15.März 2021



Performance

23.10.2012 - 29.02.2024



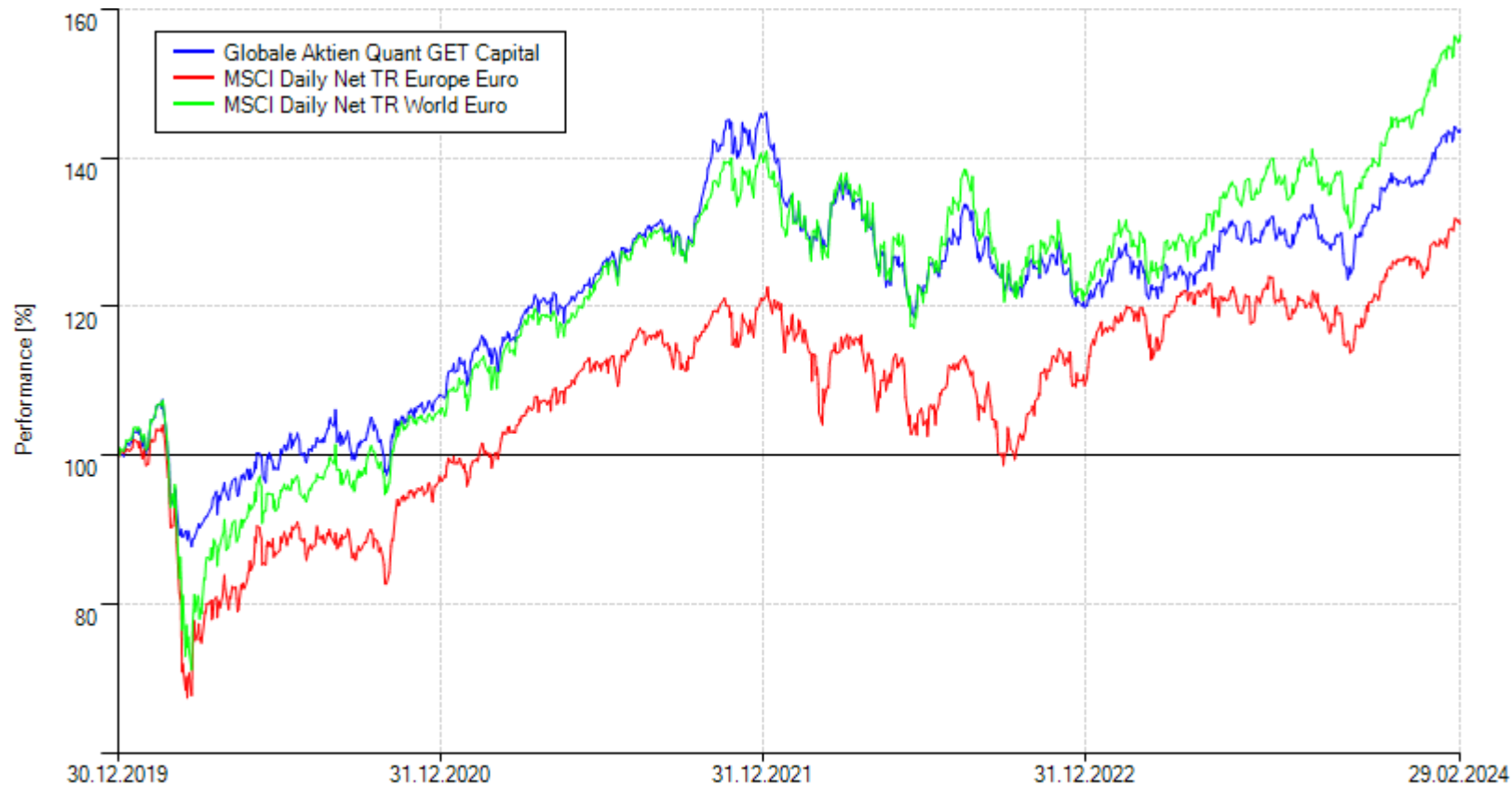
| | Return p.a. | Drawdown |
|----------------------------------|-------------|----------|
| Globale Aktien Quant GET Capital | 9.09% | -20.14% |
| MSCI Daily Net TR Europe Euro | 8.10% | -35.25% |
| MSCI Daily Net TR World Euro | 12.41% | -33.76% |

*
Publikumsfonds Auflage 23. Oktober 2012 in
Luxembourg, Übertrag / Neu Auflage in Deutschland
mit gleichem Ansatz 15.März 2021



Performance seit 2020

30.12.2019 - 29.02.2024



| | Return p.a. | Drawdown |
|----------------------------------|-------------|----------|
| Globale Aktien Quant GET Capital | 9.12% | -18.76% |
| MSCI Daily Net TR Europe Euro | 6.73% | -35.25% |
| MSCI Daily Net TR World Euro | 11.36% | -33.76% |

*
Publikumsfonds Auflage 23. Oktober 2012 in
Luxembourg, Übertrag / Neu Auflage in Deutschland
mit gleichem Ansatz 15. März 2021



Performance (Yearly)

23.10.2012 - 29.02.2024

| | Globale Aktien Quant GET Capital | MSCI Daily Net TR Europe Euro | MSCI Daily Net TR World Euro |
|-------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------------|
| 2024 | 4.96% | 3.55% | 7.68% |
| 2023 | 14.25% | 15.83% | 19.60% |
| 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
in Luxembourg, Übertrag / Neu Auflage in
Deutschland mit gleichem Ansatz 15.März
2021

* Stand: 29.02.2024



Drawdown (Yearly)

23.10.2012 – 29.02.2024

| | Globale Aktien Quant GET Capital | MSCI Daily Net TR Europe Euro | MSCI Daily Net TR World Euro |
|-------------|-------------------------------------|----------------------------------|---------------------------------|
| 2024 | -1.01% | -2.21% | -1.54% |
| 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
in Luxembourg, Übertrag / Neu Auflage in
Deutschland mit gleichem Ansatz 15. März
2021

* Stand: 29.02.2024



Performance Annualised

23.10.2012 - 29.02.2024

| | | Globale Aktien Quant GET Capital |
|----------|------|----------------------------------|
| YTD* | | 4.96% |
| 1 Jahr | | 15.14% |
| 3 Jahre | p.a. | 8.58% |
| 5 Jahre | | 10.51% |
| 7 Jahre | | 7.59% |
| 10 Jahre | | 8.24% |

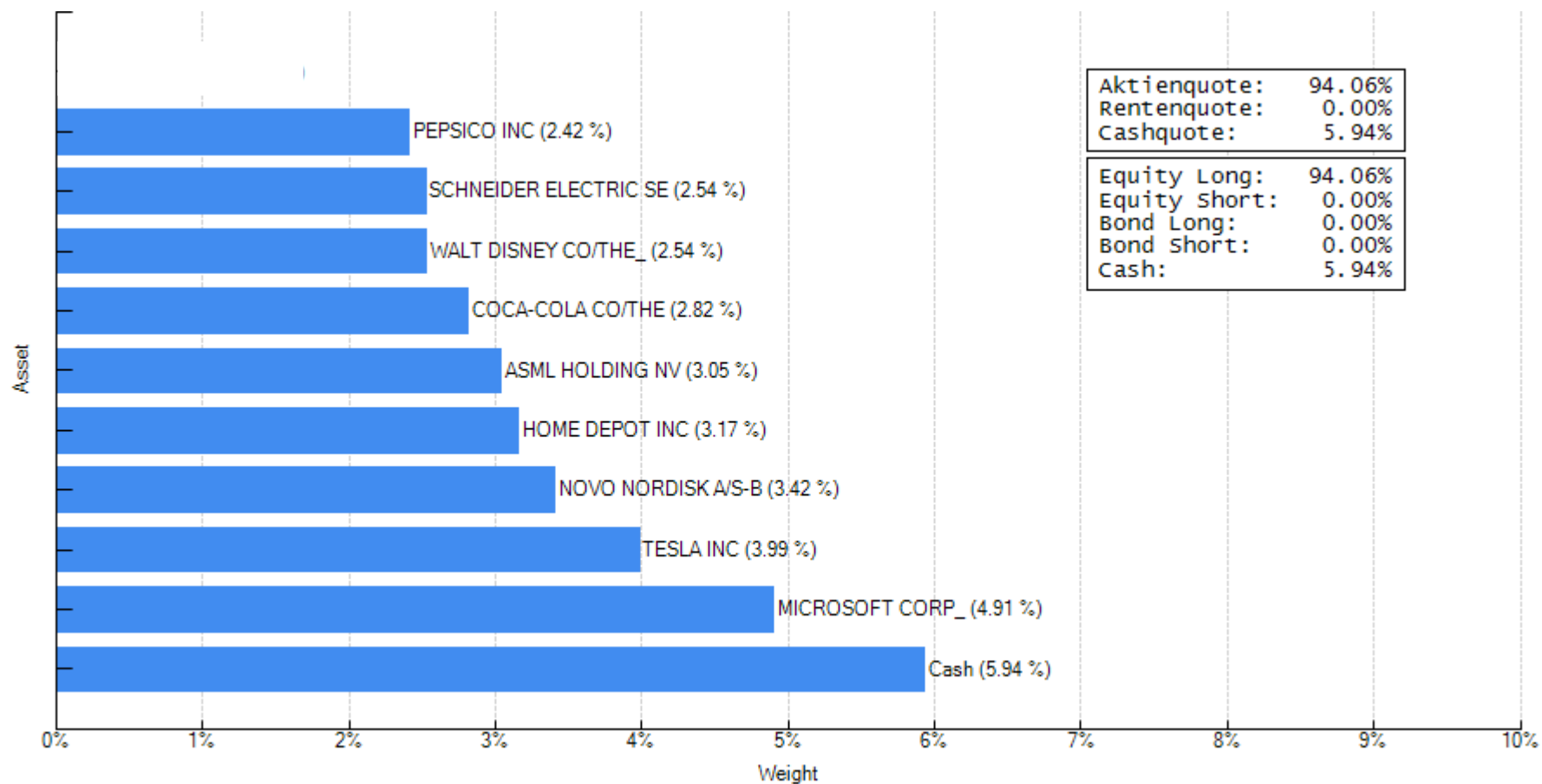
*
Publikumsfonds Auflage 23. Oktober 2012 in
Luxembourg, Übertrag / Neu Auflage in Deutschland
mit gleichem Ansatz 15.März 2021

* Stand: 29.02.2024



Allocation Quota Top 10

29.02.2024



Risk Statistics (5 Years)

23.10.2012 - 29.02.2024

| | 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 |
| Volatility | 9.87% | 11.98% | 11.98% | 13.00% | 13.07% | 10.70% | 14.92% | 14.13% | 18.88% | 17.78% |
| Value at Risk | 9.04% | 11.73% | 10.76% | 11.42% | 10.76% | 9.87% | 13.88% | 12.09% | 12.68% | 11.28% |
| Expected Shortfall | 14.26% | 18.32% | 18.45% | 19.88% | 20.28% | 16.02% | 22.63% | 21.60% | 26.70% | 25.45% |
| Sharpe Ratio | 1.23 | 0.33 | 0.64 | 0.83 | 0.77 | 1.65 | 0.52 | 0.80 | 0.66 | 0.66 |
| Deutsch Ratio VaR | 1.34 | 0.34 | 0.72 | 0.94 | 0.94 | 1.79 | 0.56 | 0.93 | 0.98 | 1.03 |
| Deutsch Ratio ESf | 0.85 | 0.22 | 0.42 | 0.54 | 0.50 | 1.10 | 0.34 | 0.52 | 0.47 | 0.46 |

Stand: 29.02.2024

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

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.

