

FACTSHEET - STAND 30.11.2023

DER AKTIONÄR Familienunternehmen Index

BESCHREIBUNG

Allein in Deutschland gibt es aktuell mehr als 400 börsennotierte Unternehmen, die familiengeführt sind. Viele davon sind Weltmarktführer in ihren Branchen. An der Börse gilt ein Unternehmen als Familienunternehmen, wenn die Gründerfamilie entweder 25 Prozent der Stimmrechte besitzt und/oder ein Familienmitglied im Aufsichtsrat oder Vorstand sitzt. So sieht es die „Family Founding Definition“ vor. Der neue Familienunternehmen Index von DER AKTIONÄR setzt auf den Erfolgsfaktor Gründerfamilie und bündelt zwölf starke Familienunternehmen aus Europa, die sich an der Börse als Top-Performer etabliert haben. Neben bekannten deutschen Größen wie Pharmahersteller Merck, Autovermieter Sixt, IT-Dienstleister Bechtle oder Photovoltaikanbieter SMA Solar sind mit Getränkehersteller Heineken, Bekleidungsunternehmen Hennes & Mauritz und Konsumgüterhersteller Swatch Group auch andere europäische Champions im Index vertreten.

HISTORISCHE WERTENTWICKLUNG*



STAMMDATEN

ISIN / WKN	DE000SLOGN76 / SLOGN7	Basiswert / Basisdatum	100 Points / 02.08.2022
Bloomberg / Reuters	AKFAMILY Index/ .AKFAMILY	Aktueller Stand	102.03
Index Berechner	Solactive AG	Dividenden	Reinvested
Index Typ	Net Total Return AR	Berechnung	9:00 am to 10:50 pm (CET), every 15 seconds
Index Währung	EUR	Historie	Available daily back to 02.08.2022
Index Komponenten	11		

KENNZAHLEN

EUR	30T	90T	180T	360T	lfd. J	Seit Auflage
Performance	8.08%	-4.03%	-6.63%	7.25%	12.40%	2.03%
Performance (p.a.)						1.52%
Volatilität (p.a.)	19.24%	16.48%	14.94%	17.23%	17.01%	18.90%
Hoch	102.21	106.88	112.35	114.24	114.24	114.24
Tief	94.40	93.57	93.57	90.07	90.77	82.23
Sharpe Ratio*	7.99	-1.17	-1.13	0.20	0.57	-0.13
Max. Drawdown	-3.07%	-12.45%	-16.72%	-18.09%	-18.09%	-20.24%
VaR 95 \ 99				-24.5% \ -47.8%		-31.7% \ -47.8%
CVaR 95 \ 99				-38.2% \ -54.4%		-41.5% \ -53.1%

* Bis einschließlich 31. Dezember 2021 werden ex-post Sharpe Ratios mittels des der Währung entsprechenden und laufeitenkongruenten LIBOR-Satzes berechnet. Ab 3. Januar 2022 werden die Sharpe Ratios über den relevanten risikolosen overnight-Satz berechnet, also SONIA (Britisches Pfund), SOFR (US Dollar) oder EURIBOR Overnight (Euro).

WÄHRUNGSaufTEILUNG

- EUR 62.9%
- DKK 9.7%
- SEK 9.5%
- GBP 9.2%
- Andere 8.9%



LÄNDERaufTEILUNG

- DE 46.2%
- DK 9.7%
- SE 9.5%
- GB 9.2%
- Andere 25.5%



TOP KOMPONENTEN 30.11.2023

Unternehmen	Ticker	Land	Währung	Gewicht
BECHTLE AG	BC8 GY Equity	DE	EUR	12.70%
MERCK KGAA	MRK GY Equity	DE	EUR	10.81%
COLOPLAST AS CLASS B	COLOB DC Equity	DK	DKK	9.66%
H&M HENNES & MAURITZ AB CLASS B	HMB SS Equity	SE	SEK	9.45%
EASYJET PLC	EZJ LN Equity	GB	GBP	9.16%
DERMAPHARM HOLDING SE	DMP GY Equity	DE	EUR	9.08%
SWATCH GROUP AG	UHR SE Equity	CH	CHF	8.87%
HEINEKEN NV	HEIA NA Equity	NL	EUR	8.77%
SIXT SE	SIX2 GY Equity	DE	EUR	8.41%
PERNOD RICARD SA	RI FP Equity	FR	EUR	7.91%

HINWEISE

© Solactive AG, 2023. Alle Rechte vorbehalten.

Alle in diesem Factsheet enthaltenen Informationen sind allgemeiner Natur, nicht auf die Bedürfnisse von einzelnen Personen, Unternehmen oder Personengruppen ausgerichtet und dienen ausschließlich Informationszwecken. Die Informationen stammen aus öffentlich zugänglichen Quellen, die als zuverlässig erachtet werden. Die Solactive AG gibt keine ausdrückliche oder stillschweigende Garantie oder Zusicherung ab, dass diese Informationen korrekt oder vollständig sind. Die Inhalte des Factsheets werden "wie vorliegend" bereitgestellt. Die Solactive AG übernimmt keine Verantwortung oder Haftung für Fehler oder Verluste durch die Verwendung dieses Factsheets oder der darin enthaltenen Informationen oder Daten. Die Solactive AG haftet nicht für direkte oder indirekte Schäden oder Folgeschäden im Zusammenhang mit der Verwendung des Factsheets und seines Inhalts, selbst wenn die Solactive AG über die Möglichkeit solcher Schäden informiert wurde.

Es ist nicht möglich, direkt in einen Index zu investieren. Ein Exposure im Hinblick auf Vermögenswerte, die durch einen Index abgebildet werden, ist mittels investierbarer Finanzinstrumente möglich, die darauf abzielen, eine Anlagerendite zu erzielen, die auf der Wertentwicklung eines Index basiert. Eine Entscheidung, in ein solches Finanzinstrument zu investieren, sollte nicht auf der Grundlage einer der in diesem Dokument dargelegten Aussagen getroffen werden. Potenzielle Anleger sollten erst nach sorgfältiger Abwägung der mit einer Anlage in solche Finanzinstrumente verbundenen Risiken eine Anlage tätigen. Solche Risiken sind beispielsweise in einem Emissionsprospekt oder einem ähnlichen Dokument beschrieben, das vom oder im Namen des Emittenten des Finanzinstruments erstellt wird.

Die Finanzinstrumente werden von der Solactive AG nicht gesponsert, gefördert, verkauft oder auf eine andere Art und Weise unterstützt und die Solactive AG bietet keinerlei ausdrückliche oder stillschweigende Garantie oder Zusicherung, weder hinsichtlich der Ergebnisse aus einer Nutzung des Index- und/oder der Index-Marke noch hinsichtlich des Indexstands zu irgendeinem bestimmten Zeitpunkt noch in sonstiger Hinsicht. Die Solactive AG gibt keine Zusicherung, dass Finanzinstrumente, in denen auf den Index Bezug genommen wird, die Wertentwicklung des Index genau abbilden oder eine positive Anlagerendite liefern. Die Solactive AG ist kein Anlageberater und nichts in diesem Factsheet stellt eine Empfehlung der Solactive AG dar, eine Anlage in Finanzinstrumente zu tätigen, noch stellt es in irgendeiner Weise eine Ansicht der Solactive AG in Bezug auf eine Anlage in ein Finanzinstrument dar. Die Aufnahme eines Wertpapiers in einen Index stellt weder eine Empfehlung der Solactive AG zum Kauf, Verkauf oder Halten eines solchen Wertpapiers dar, noch ist dies als Anlageberatung zu verstehen.

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit sollte nicht als Indikator oder Garantie für eine zukünftige Wertentwicklung angesehen werden. Die Diagramme und Grafiken werden ausschließlich zu Illustrationszwecken zur Verfügung gestellt.

Diese Information wird ausschließlich von der Solactive AG, Platz der Einheit 1, D-60327 Frankfurt am Main | E-Mail: indexing@solactive.com zur Verfügung gestellt.

"Solactive", "Solactive GBS", "German Index Engineering" und das Logo  sind eingetragene Marken der Solactive AG.

Die Informationen in diesem Dokument stellen keine Steuer-, Rechts- oder Anlageberatung dar. Das Factsheet und sein Inhalt dürfen ohne vorherige schriftliche Zustimmung der Solactive AG weder ganz noch teilweise verändert, reproduziert, weitergegeben oder gespeichert werden.