FACTSHEET - STAND 02.05.2025
Multi Asset Strategie nachhaltig ESG IP

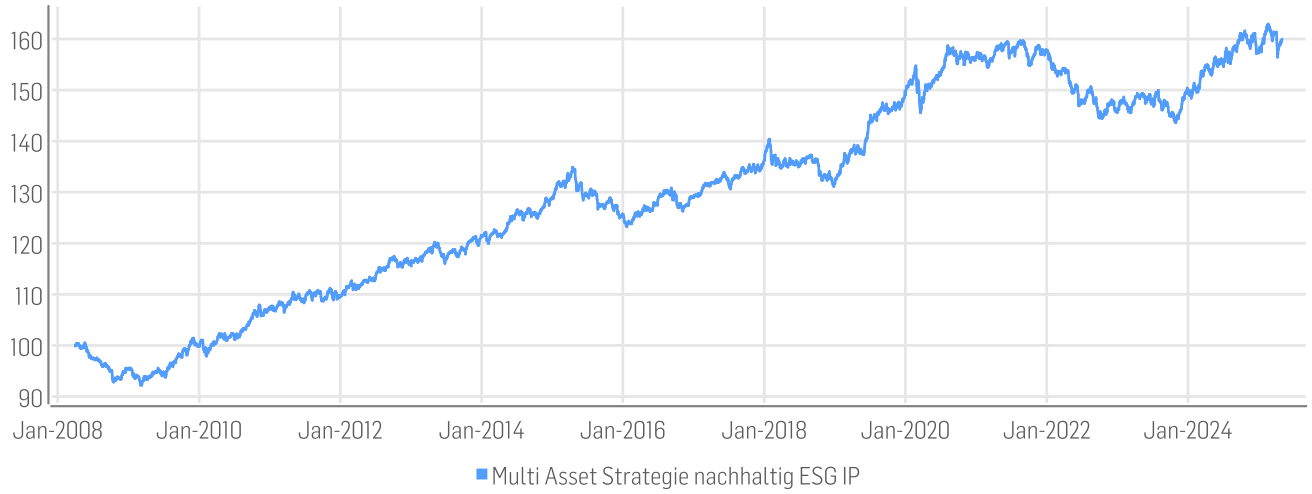
BESCHREIBUNG

Strategie und Funktionsweise

Der Multi Asset Strategie nachhaltig ESG IP ist ein sogenannter Multi Asset Index, der in verschiedene Märkte aus drei unterschiedlichen Anlageklassen investiert: Aktien, Staatsanleihen, und Rohstoffe.

In der Anlageklasse Aktien werden Investitionen in den STOXX Europe 600 ESG-X sowie in den US-amerikanischen Leitindex, den S&P 500 ESG vorgenommen. Somit partizipiert der Index bestmöglich an den globalen Aktienmärkten. In der Anlageklasse Staatsanleihen erfolgen Investitionen in deutsche und US-amerikanische Staatsanleihen mit einer 2- und 10-jährigen Laufzeit. Im Bereich der Rohstoffe erfolgt die Investition in Gold. Die Anlageklassen werden dabei in zwei verschiedene „Körbe" eingeteilt. Der eine beinhaltet Staatsanleihen und Gold. Der andere setzt sich aus Aktien zusammen. Dieser verfügt über eine höhere Renditeaussicht, gleichzeitig aber auch höhere erwartete Kursschwankungen. Um die Kursschwankungen des Index zu begrenzen und insbesondere hohe Verluste in schwankungsanfälligeren Marktphasen zu reduzieren, erfolgt die Aufteilung der Investition des Index zwischen diesen Körben auf Basis der erwarteten Preisschwankungen („implizite Volatilitäten"). Die Gewichtung erfolgt hier gemäß der inversen Volatilität, d. h. je stabiler die Entwicklung eines Korbes ist, desto höheres Gewicht hat er am Portfolio. Die Aufteilung innerhalb des Korbs der Aktien ist gleich gewichtet und wird jeden Monat neu adjustiert. Die Aufteilung innerhalb des Staatsanleihen und Gold- Korbs hingegen erfolgt auf Basis eines Trendsteuerungssystems. Ziel des Indexes ist die Einhaltung einer durchschnittlichen Volatilität des Index i.H.v.5% p.a. Diese wird durch eine dynamische Steuerung des Investitionsgrades erreicht. Ein Indexkomitee überwacht die Entwicklung des Indexes um die Einhaltung der Zielvolatilität zu gewährleisten und ist berechtigt einzelne Komponenten des Indexes auszutauschen um auch den Nachhaltigkeitscharakter des Indexes sicherzustellen. Das Rendite-Risiko-Profil bei einer derartigen Anpassung muss dabei unverändert bleiben. Eine Indexgebühr fällt nicht an. Die Rendite des Index wird als sogenannter Excess Return Index ausgewiesen; dies entsprechend dem Mehrertrag oberhalb der Verzinsung von Cash.

HISTORISCHE WERTENTWICKLUNG



FACTSHEET - STAND 02.05.2025
Multi Asset Strategie nachhaltig ESG IP

HINWEISE

* Die Wertentwicklung in der Vergangenheit stellt keine Garantie für zukünftige Ergebnisse dar und kann niedriger oder höher sein als die gegenwärtige Wertentwicklung. Indexrenditen stellen keine Garantie für irgendwelche Renditen von Finanzprodukten dar, die mit dem Index verbunden sind. Die historische Wertentwicklung wurde per Simulation ermittelt; der Index wird erst seit dem 1. September 2017 tatsächlich ermittelt. Alle Informationen über die Wertentwicklung von Finanzprodukten, die sich auf den Index beziehen, können vorübergehende Verzichte von Kosten und/oder Gebühren widerspiegeln und beinhalten keine Versicherungs-/Jahresgebühren und Aufwendungen.

Dieser Info-Service wird exklusiv von Solactive AG, Platz der Einheit 1, D-60327 Frankfurt am Main angeboten, E-Mail indexing@solactive.com. Disclaimer: Das Finanzinstrument wird 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 Index-Stands zu irgendeinem bestimmten Zeitpunkt noch in sonstiger Hinsicht. Der Index wird durch die Solactive AG berechnet und veröffentlicht, wobei sich die Solactive AG nach besten Kräften bemüht, für die Richtigkeit der Berechnung des Index Sorge zu tragen. Es besteht für die Solactive AG – unbeschadet ihrer Verpflichtungen gegenüber dem Emittenten – keine Verpflichtung gegenüber Dritten, einschließlich Investoren und/oder Finanzintermediären des Finanzinstruments, auf etwaige Fehler in dem Index hinzuweisen. Weder die Veröffentlichung des Index durch die Solactive AG noch die Lizenzierung des Index sowie der Index-Marke für die Nutzung im Zusammenhang mit dem Finanzinstrument stellt eine Empfehlung der Solactive AG zur Kapitalanlage dar oder beinhaltet in irgendeiner Weise eine Zusicherung oder Meinung der Solactive AG hinsichtlich einer etwaigen Investition in dieses Finanzinstrument. Dieses Dokument dient nur der Information von und darf nur verwendet werden durch professionelle Berater. Die in diesem Dokument enthaltenen Informationen stellen keine Steuer- Rechts- oder Anlageberatung dar und sind nicht als Empfehlung für den Kauf oder Verkauf von Wertpapieren gedacht. Die in diesem Dokument enthaltenen Informationen und Meinungen wurden aus öffentlichen Quellen entnommen, die als zuverlässig eingeschätzt wurden, aber es wird keine ausdrückliche oder stillschweigende Zusicherung gegeben oder Gewährleistung übernommen, dass diese Informationen korrekt oder vollständig sind und man sollte sich nicht auf die Information als solche verlassen. Solactive AG und alle anderen in diesem Dokument erwähnten Unternehmen sind nicht verantwortlich für die Folgen des Vertrauens auf eine hierin enthaltene Meinung oder Erklärung oder für irgendeine Unterlassung.