

# FACTSHEET - STAND 24.04.2024

## Concinnity Conscious Companies Index GTR Index

### BESCHREIBUNG

The Concinnity Conscious Companies Index (the "Index") is designed to provide exposure to U.S.-listed companies that Concinnity Advisors LP, (the "Index Provider") believes appear to achieve financial performance in a sustainable and responsible manner, as measured by their ability to achieve positive outcomes that are consistent with a multi-stakeholder operating system ("MsOS"), as defined by the Index Provider. The Index Provider conducts its analysis based on the following five key stakeholder groups: (1) Customers, (2) Employees, (3) Suppliers, (4) Stock and Debt Holders, and (5) Communities in which the companies operate. The universe of companies eligible for inclusion in the Index is comprised of US-listed firms with a market capitalization greater than \$2 billion at the time of the initial screen. The Index typically consists of between 100 and 125 stocks, and is equal weighted. CONCINNITY CONSCIOUS COMPANIES INDEX is the service mark of Concinnity Advisors,LP.

### HISTORISCHE WERTENTWICKLUNG\*



### STAMMDATEN

ISIN / WKN	DE000SLA1946 / SLA194	Basiswert / Basisdatum	100 Points / 30.07.2010
Bloomberg / Reuters	KRMATR Index / .KRMATR	Aktueller Stand	590.28
Index Berechner	Solactive AG	Dividenden	Reinvested (Total Return Index)
Index Typ	Total Return	Berechnung	09:30am to 16:30pm (EST), every 15 seconds
Index Währung	USD	Historie	Available daily back to 30.07.2010
Index Komponenten	166		

FACTSHEET - STAND 24.04.2024  
 Concinnity Conscious Companies Index GTR Index

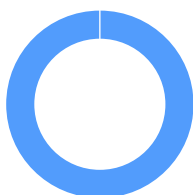
**KENNZAHLEN**

USD	30T	90T	180T	360T	lfd. J	Seit Auflage
Performance	-2.61%	3.08%	23.79%	19.46%	5.19%	14.68%
Performance (p.a.)						5.09%
Volatilität (p.a.)	12.26%	11.82%	11.57%	11.63%	11.50%	18.01%
Hoch	611.61	611.61	611.61	611.61	611.61	611.61
Tief	576.97	568.12	476.83	476.83	549.35	420.64
Sharpe Ratio*	-2.68	0.66	4.23	1.24	1.03	-0.01
Max. Drawdown	-5.66%	-5.66%	-5.66%	-10.92%	-5.66%	-25.59%
VaR 95 \ 99				-18.7% \ -25.7%		-28.3% \ -53.6%
CVaR 95 \ 99				-22.9% \ -27.2%		-41.7% \ -63.2%

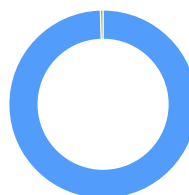
\* Bis einschließlich 31. Dezember 2021 werden ex-post Sharpe Ratios mittels des der Währung entsprechenden und laufeitenkongruenten LIBOR-Satzes berechnet. Ab 3. Januar 2022 werden die Sharpe Ratios über den relevanten risikolosen overnight-Satz berechnet, also SONIA (Britisches Pfund), SOFR (US Dollar)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

**WÄHRUNGSaufTEILUNG**

- USD 100.0%


**LÄNDERaufTEILUNG**

- US 99.5%
- CA 0.5%


**TOP KOMPONENTEN 24.04.2024**

Unternehmen	Ticker	Land	Währung	Gewicht
MICROSOFT CORP	MSFT UW Equity	US	USD	6.22%
APPLE INC	AAPL UW Equity	US	USD	5.01%
NVIDIA CORP	NVDA UW Equity	US	USD	3.40%
ALPHABET INC-CL A	GOOGL UW Equity	US	USD	3.09%
AMAZON.COM INC	AMZN UW Equity	US	USD	2.71%
META PLATFORMS INC	META UW Equity	US	USD	1.37%
DELL TECHNOLOGIES INC - C	DELL UN Equity	US	USD	0.68%
DICKS SPORTING GOODS INC	DKS UN Equity	US	USD	0.65%
AMERICAN EXPRESS CO	AXP UN Equity	US	USD	0.61%
VALERO ENERGY	VLO UN Equity	US	USD	0.61%
CATERPILLAR INC	CAT UN Equity	US	USD	0.59%
CUMMINS INC	CMI UN Equity	US	USD	0.59%
EBAY INC	EBAY UW Equity	US	USD	0.58%

FACTSHEET - STAND 24.04.2024  
Concinnity Conscious Companies Index GTR Index

Unternehmen	Ticker	Land	Währung	Gewicht
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	EW UN Equity	US	USD	0.58%
KROGER CO	KR UN Equity	US	USD	0.58%

## HINWEISE

© Solactive AG, 2024. 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](mailto: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.