

FACTSHEET - STAND 29.11.2023

Global Megatrends Index

BESCHREIBUNG

Megatrends are global equity themes that define our future in the context of a global transforming world. The 10 megatrends selected for this index are obesity & wellness, climate change, food security, longevity, millennials, education, safety, energy efficiency, waste and water. The index provides exposure to those identified megatrends by selecting high dividend yielding and low volatility stocks out of a selection of 30 industry sectors which were deemed the most likely to be positively impacted by them. The index is rebalanced quarterly and includes constraints on the number of constituents per industry sector. The 30 industry sectors are fixed.

HISTORISCHE WERTENTWICKLUNG*



STAMMDATEN

ISIN / WKN	DE000SLA1F56 / SLA1F5	Basiswert / Basisdatum	100 Points / 07.03.2008
Bloomberg / Reuters	MTRENDS Index / .MTRENDS	Aktueller Stand	243.93
Index Berechner	Solactive AG	Dividenden	Excluded (Price Return Index)
Index Typ	Price Return	Berechnung	08:30am to 10:50pm (CET), every 15 seconds
Index Währung	EUR	Historie	Available daily back to 07.03.2008
Index Komponenten	51		

KENNZAHLEN

EUR	30T	90T	180T	360T	lfd. J	Seit Auflage
Performance	3.83%	-0.32%	-0.95%	-0.08%	2.14%	143.93%
Performance (p.a.)						5.83%
Volatilität (p.a.)	8.80%	10.75%	10.05%	9.72%	9.74%	13.79%
Hoch	243.93	250.03	251.39	252.29	252.29	265.53
Tief	234.93	231.57	231.57	231.57	231.57	72.70
Sharpe Ratio*	6.15	-0.48	-0.58	-0.41	-0.16	0.14
Max. Drawdown	-1.89%	-7.38%	-7.88%	-8.21%	-8.21%	-33.50%
VaR 95 \ 99				-16.1% \ -23.0%		-19.4% \ -40.9%
CVaR 95 \ 99				-20.5% \ -28.3%		-33.3% \ -62.4%

* 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).

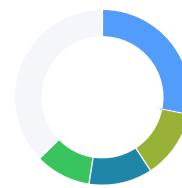
WÄHRUNGSAUFTeilUNG

- EUR 36.7%
- USD 34.4%
- GBP 11.3%
- JPY 5.6%
- Andere 12.0%



LÄNDERAUFTeilUNG

- US 28.1%
- GB 12.6%
- FR 11.7%
- ES 10.3%
- Andere 37.3%



TOP KOMPONENTEN 29.11.2023

Unternehmen	Ticker	Land	Währung	Gewicht
IBERDROLA SA	IBE SQ Equity	ES	EUR	2.91%
ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS SA	ACS SQ Equity	ES	EUR	2.85%
FORTIS INC	FTS CT Equity	CA	CAD	2.65%
VINCI SA	DG FP Equity	FR	EUR	2.62%
KRAFT HEINZ CO/THE	KHC UW Equity	US	USD	2.61%
BOUYGUES SA	EN FP Equity	FR	EUR	2.49%
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	IBM UN Equity	US	USD	2.44%
NATIONAL GRID PLC	NG/ LN Equity	GB	GBP	2.42%
TESCO PLC	TSCO LN Equity	GB	GBP	2.38%
RED ELECTRICA CORP SA	RED SQ Equity	ES	EUR	2.37%
EIFFAGE SA	FGR FP Equity	FR	EUR	2.35%
EDP ENERGIAS DE PORTUGAL SA	EDP PL Equity	PT	EUR	2.35%
UNITED UTILITIES PLC	UU/ LN Equity	GB	GBP	2.32%

FACTSHEET - STAND 29.11.2023
Global Megatrends Index

Unternehmen	Ticker	Land	Währung	Gewicht
SEVERN TRENT PLC	SVT LN Equity	GB	GBP	2.30%
TOSOH CORP	4042 JT Equity	JP	JPY	2.30%

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.