

FACTSHEET - STAND 18.10.2019

US ESG Minimum Variance Index NR

BESCHREIBUNG

The aim of the index is to deliver the performance of an ESG best-in-class filtered selection of liquid stocks from the Solactive US Large Cap Index, weighted in such a way to minimize the volatility of the portfolio

HISTORISCHE WERTENTWICKLUNG*



STAMMDATEN

ISIN / WKN	DE000SLA1XR7 / SLA1XR	Basiswert / Basisdatum	100 Points / 08.03.2016
Bloomberg / Reuters	ESGUSMVN Index / .ESGUSMVN	Aktueller Stand	284.35
Index Berechner	Solactive AG	Dividenden	Net dividends are reinvested (Net Total Return Index)
Index Typ	Net Total Return	Berechnung	09:00am to 10:30pm (CET), every 15 seconds
Index Währung	USD	Historie	Available daily back to 18.12.2009
Index Komponenten	81		

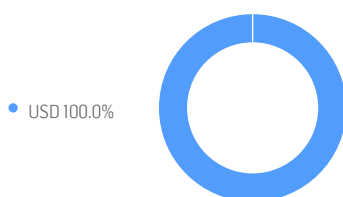
KENNZAHLEN

	30T	90T	180T	360T	lfd. J	Seit Auflage
Performance	0.4%	3.0%	10.3%	16.2%	22.4%	51.0%
Performance (p.a.)	-	-	-	-	-	12.1%
Volatilität (p.a.)	8.9%	11.3%	10.2%	11.1%	9.5%	9.3%
Hoch	284.38	284.38	284.38	284.38	284.38	284.38
Tief	278.01	268.87	256.50	222.52	228.70	188.27
Sharpe Ratio	0.38	0.94	1.97	1.30	2.84	1.09
Max. Drawdown	-2.2%	-3.1%	-3.7%	-11.8%	-3.7%	-12.2%
VaR 95 \ 99				-19.8% \ -32.4%		-15.0% \ -26.6%
CVaR 95 \ 99				-26.3% \ -35.6%		-23.4% \ -37.5%

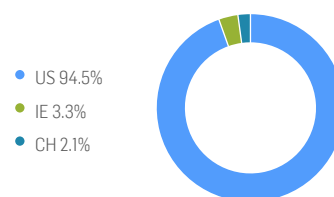
KENNZAHLEN - GBS - Solactive GBS Developed Markets Pacific All Cap USD Index NTR

USD	30T	90T	180T	360T	lfd. J	Seit Auflage
Performance	0.8%	0.8%	2.8%	7.1%	13.0%	1.7%
Performance (p.a.)	-	-	-	-	-	0.9%
Volatilität (p.a.)	8.3%	10.9%	10.6%	13.2%	11.0%	12.5%
Hoch	1132.64	1132.64	1132.64	1132.64	1132.64	1231.37
Tief	1104.46	1058.55	1054.46	954.39	996.74	954.39
Sharpe Ratio	1.06	0.14	0.36	0.40	1.33	-0.09
Max. Drawdown	-2.5%	-5.7%	-6.4%	-11.7%	-6.4%	-22.5%
VaR 95 \ 99				-22.2% \ -35.0%		-20.0% \ -43.9%
CVaR 95 \ 99				-31.8% \ -48.5%		-31.4% \ -51.4%

WÄHRUNGSaufTEILUNG



LÄNDERaufTEILUNG



TOP KOMPONENTEN 18.10.2019

Unternehmen	Ticker	Land	Währung	Gewicht
NEWMONT GOLDCORP CORP	NEM UN Equity	US	USD	4.33%
MCDONALDS CORP	MCD UN Equity	US	USD	3.85%
CELGENE CORP	CELG UW Equity	US	USD	3.72%
DENTSPLY SIRONA INC	XRAY UW Equity	US	USD	3.39%
SEMPRA ENERGY	SRE UN Equity	US	USD	3.04%
CITRIX SYSTEMS INC	CTXS UW Equity	US	USD	2.81%
EXTRA SPACE STORAGE INC	EXR UN Equity	US	USD	2.77%
AUTOZONE INC	AZO UN Equity	US	USD	2.67%
DUKE ENERGY CORP	DUK UN Equity	US	USD	2.62%
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	ICE UN Equity	US	USD	2.34%
CONSOLIDATED EDISON INC	ED UN Equity	US	USD	2.33%
FIRST REPUBLIC BANK	FRC UN Equity	US	USD	2.33%
YUM! BRANDS	YUM UN Equity	US	USD	2.24%
MEDTRONIC PLC	MDT UN Equity	IE	USD	2.21%
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	CMG UN Equity	US	USD	2.21%
WALMART INC	WMT UN Equity	US	USD	2.08%
EVERSOURCE ENERGY	ES UN Equity	US	USD	1.90%
NEXTERA ENERGY INC	NEE UN Equity	US	USD	1.86%
HERSHEY CO/THE	HSY UN Equity	US	USD	1.84%
REPUBLIC SERVICES INC	RSG UN Equity	US	USD	1.81%
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	UAL UW Equity	US	USD	1.80%
AT&T	T UN Equity	US	USD	1.80%
CHURCH & DWIGHT CO INC	CHD UN Equity	US	USD	1.79%
OMNICOM GROUP	OMC UN Equity	US	USD	1.73%
GARMIN LTD	GRMN UW Equity	CH	USD	1.69%
GENERAL MOTORS CO	GM UN Equity	US	USD	1.63%
DTE ENERGY CO	DTE UN Equity	US	USD	1.59%
EQUITY RESIDENTIAL	EQR UN Equity	US	USD	1.48%
PEPSICO INC	PEP UW Equity	US	USD	1.47%
VULCAN MATERIALS CO	VMC UN Equity	US	USD	1.47%
AMERICAN ELECTRIC POWER	AEP UN Equity	US	USD	1.44%
EBAY INC	EBAY UW Equity	US	USD	1.41%
JM SMUCKER CO/THE	SJM UN Equity	US	USD	1.33%
SYSCO CORP	SYU UN Equity	US	USD	1.30%
ENTERGY CORP	ETR UN Equity	US	USD	1.18%
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	HIG UN Equity	US	USD	1.14%
GENERAL MILLS INC	GIS UN Equity	US	USD	1.11%
CME GROUP	CME UW Equity	US	USD	1.10%
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	JCI UN Equity	IE	USD	1.10%
COCA-COLA CO/THE	KO UN Equity	US	USD	1.03%
VERIZON COMMUNICATIONS INC	VZ UN Equity	US	USD	1.03%

FACTSHEET - STAND 18.10.2019
US ESG Minimum Variance Index NR

Unternehmen	Ticker	Land	Währung	Gewicht
PPL CORP	PPL UN Equity	US	USD	1.02%
KROGER CO	KR UN Equity	US	USD	0.88%
PUBLIC SVC ENTERPRISE	PEG UN Equity	US	USD	0.79%
VF CORP	VFC UN Equity	US	USD	0.78%
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	MKC UN Equity	US	USD	0.76%
KINDER MORGAN INC	KMI UN Equity	US	USD	0.71%
MARTIN MARIETTA MATERIALS	MLM UN Equity	US	USD	0.69%
CHEVRON CORP	CVX UN Equity	US	USD	0.69%
AMERICAN TOWER CORP	AMT UN Equity	US	USD	0.68%
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	HLT UN Equity	US	USD	0.67%
DOLLAR TREE	DLTR UW Equity	US	USD	0.66%
XCEL ENERGY INC	XEL UW Equity	US	USD	0.62%
EQUINIX INC	EQIX UW Equity	US	USD	0.59%
COMCAST CORP-CLASS A	CMCSA UW Equity	US	USD	0.59%
DARDEN RESTAURANTS	DRI UN Equity	US	USD	0.58%
VERISK ANALYTICS INC	VRSK UW Equity	US	USD	0.57%
ESSEX PROPERTY TRUST INC	ESS UN Equity	US	USD	0.54%
MOTOROLA SOLUTIONS INC	MSI UN Equity	US	USD	0.50%
NISOURCE INC	NI UN Equity	US	USD	0.47%
CHUBB LTD	CB UN Equity	CH	USD	0.45%
SIMON PROPERTY GROUP INC	SPG UN Equity	US	USD	0.45%
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	PNW UN Equity	US	USD	0.43%
WEC ENERGY GROUP INC	WEC UN Equity	US	USD	0.43%
DIGITAL REALTY TRUST INC	DLR UN Equity	US	USD	0.40%
AFLAC INC	AFL UN Equity	US	USD	0.38%
WELLTOWER INC	WELL UN Equity	US	USD	0.37%
VENTAS INC	VTR UN Equity	US	USD	0.33%
BAKER HUGHES CO	BKR UN Equity	US	USD	0.33%
CMS ENERGY CORP	CMS UN Equity	US	USD	0.31%
WW GRAINGER INC	GWW UN Equity	US	USD	0.24%
VIACOM INC-CLASS B	VIAB UW Equity	US	USD	0.22%
O REILLY AUTOMOTIVE INC	ORLY UW Equity	US	USD	0.21%
AVALONBAY COMMUNITIES INC	AVB UN Equity	US	USD	0.16%
EXXON MOBIL CORP	XOM UN Equity	US	USD	0.09%
GENERAL ELECTRIC CO	GE UN Equity	US	USD	0.09%
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	BMJ UN Equity	US	USD	0.08%
FACEBOOK INC	FB UW Equity	US	USD	0.06%
MARSH & MCLENNAN COS	MMC UN Equity	US	USD	0.06%
TWITTER INC	TWTR UN Equity	US	USD	0.05%
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC	AIG UN Equity	US	USD	0.05%

HINWEISE

© Solactive AG, 2019. 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.