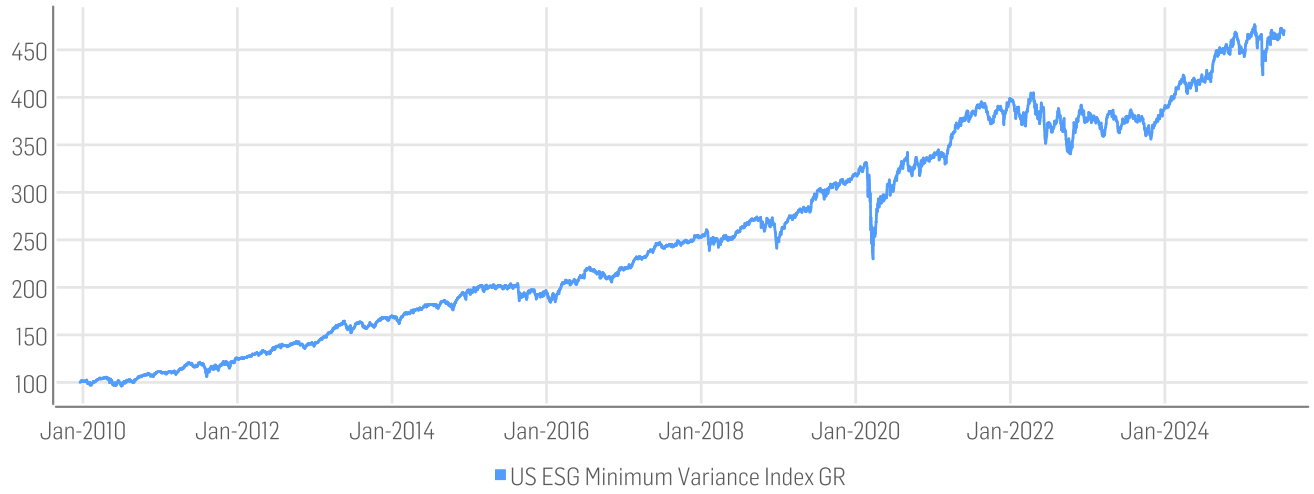
FACTSHEET - STAND 18.07.2025
US ESG Minimum Variance Index GR

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	DE000SLA1XS5 / SLA1XS	Basiswert / Basisdatum	100 Points / 08.03.2016
Bloomberg / Reuters	ESGUSMVG Index / .ESGUSMVG	Aktueller Stand	470.35
Index Berechner	Solactive AG	Dividenden	All dividends are reinvested (Total Return Index)
Index Typ	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	88		

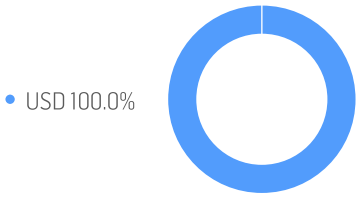
FACTSHEET - STAND 18.07.2025
US ESG Minimum Variance Index GR

KENNZAHLEN

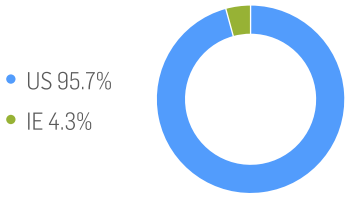
USD	30T	90T	180T	360T	lfd. J	Seit Auflage
Performance	2.16%	5.29%	3.18%	12.08%	4.94%	136.53%
Performance (p.a.)						9.63%
Volatilität (p.a.)	8.87%	10.84%	15.59%	12.61%	15.17%	13.53%
Hoch	472.80	472.80	476.49	476.49	476.49	476.49
Tief	460.40	438.53	423.66	416.34	423.66	198.85
Sharpe Ratio*	2.86	1.75	0.14	0.63	0.32	0.39
Max. Drawdown	-1.48%	-2.17%	-11.09%	-11.09%	-11.09%	-30.58%
VaR 95 \ 99				-16.3% \ -30.4%		-18.3% \ -35.4%
CVaR 95 \ 99				-29.2% \ -61.7%		-31.8% \ -64.7%

* Bis einschließlich 31. Dezember 2021 werden ex-post Sharpe Ratios mittels des der Währung entsprechenden und laufzeitenkonkruenten 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



LÄNDERAUFTEILUNG



TOP KOMPONENTEN 18.07.2025

Unternehmen	Ticker	Land	Währung	Gewicht
CME GROUP INC	CME UW Equity	US	USD	4.53%
MCKESSON CORP	MCK UN Equity	US	USD	4.13%
CENCORA INC	COR UN Equity	US	USD	3.29%
KROGER CO	KR UN Equity	US	USD	3.19%
AUTOZONE INC	AZO UN Equity	US	USD	3.13%
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	EW UN Equity	US	USD	3.12%
ALTRIA GROUP INC	MO UN Equity	US	USD	3.06%
CENTERPOINT ENERGY INC	CNP UN Equity	US	USD	3.06%
WASTE MANAGEMENT INC	WM UN Equity	US	USD	2.70%
TYSON FOODS INC	TSN UN Equity	US	USD	2.51%
VERIZON COMMUNICATIONS INC	VZ UN Equity	US	USD	2.46%
ALPHABET INC-CL A	GOOGL UW Equity	US	USD	2.39%
KEURIG DR PEPPER INC	KDP UW Equity	US	USD	2.29%
JOHNSON & JOHNSON	JNJ UN Equity	US	USD	2.28%

FACTSHEET - STAND 18.07.2025
US ESG Minimum Variance Index GR

Unternehmen	Ticker	Land	Währung	Gewicht
ALPHABET INC C-SHARES	GOOG UW Equity	US	USD	2.21%
DATADOG INC	DDOG UW Equity	US	USD	2.17%
DUKE ENERGY CORP	DUK UN Equity	US	USD	2.10%
PROGRESSIVE CORP	PGR UN Equity	US	USD	1.99%
KIMBERLY-CLARK CORP	KMB UW Equity	US	USD	1.92%
CMS ENERGY CORP	CMS UN Equity	US	USD	1.73%
MICROSOFT CORP	MSFT UW Equity	US	USD	1.65%
MCDONALDS CORP	MCD UN Equity	US	USD	1.64%
CLOROX COMPANY	CLX UN Equity	US	USD	1.58%
AT&T	T UN Equity	US	USD	1.57%
DEXCOM INC	DXCM UW Equity	US	USD	1.55%
GENERAL MILLS INC	GIS UN Equity	US	USD	1.47%
WILLIS TOWERS WATSON PLC	WTW UW Equity	IE	USD	1.42%
PFIZER INC	PFE UN Equity	US	USD	1.39%
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	BAH UN Equity	US	USD	1.35%
WW GRAINGER INC	GWW UN Equity	US	USD	1.33%
AMERICAN ELECTRIC POWER COMPANY INC	AEP UW Equity	US	USD	1.32%
WEC ENERGY GROUP INC	WEC UN Equity	US	USD	1.25%
EXELON CORP	EXC UW Equity	US	USD	1.18%
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	FLUT UN Equity	IE	USD	1.18%
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	ZM UW Equity	US	USD	1.14%
CARDINAL HEALTH INC	CAH UN Equity	US	USD	1.11%
CIGNA GROUP	CI UN Equity	US	USD	1.02%
HERSHEY CO/THE	HSY UN Equity	US	USD	0.95%
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	ICE UN Equity	US	USD	0.87%
D R HORTON INC	DHI UN Equity	US	USD	0.86%
TJX COMPANIES INC	TJX UN Equity	US	USD	0.86%
AON PLC	AON UN Equity	IE	USD	0.83%
DELL TECHNOLOGIES INC - C	DELL UN Equity	US	USD	0.77%
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	CMG UN Equity	US	USD	0.76%
CHEVRON CORP	CVX UN Equity	US	USD	0.73%
CONSOLIDATED EDISON INC	ED UN Equity	US	USD	0.73%
NVIDIA CORP	NVDA UW Equity	US	USD	0.72%
FORTINET INC	FTNT UW Equity	US	USD	0.70%
SMURFIT WESTROCK PLC	SW UN Equity	IE	USD	0.69%
KENVUE INC	KVUE UN Equity	US	USD	0.68%
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	BMY UN Equity	US	USD	0.66%
NVR INC	NVR UN Equity	US	USD	0.66%
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	ADM UN Equity	US	USD	0.64%
REPUBLIC SERVICES INC	RSG UN Equity	US	USD	0.64%
EQT CORP	EQT UN Equity	US	USD	0.63%
COCA-COLA CO/THE	KO UN Equity	US	USD	0.56%
HUMANA INC	HUM UN Equity	US	USD	0.51%
FOX CORP CLASS A (NEW)	FOXA UW Equity	US	USD	0.51%

Unternehmen	Ticker	Land	Währung	Gewicht
JABIL INC	JBL UN Equity	US	USD	0.50%
CENTENE CORP	CNC UN Equity	US	USD	0.49%
BJS WHOLESALE CLUB HOLDINGS	BJ UN Equity	US	USD	0.46%
AMEREN CORP	AEE UN Equity	US	USD	0.45%
SCHWAB (CHARLES) CORP	SCHW UN Equity	US	USD	0.45%
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	LPLA UW Equity	US	USD	0.41%
DIGITAL REALTY TRUST INC	DLR UN Equity	US	USD	0.40%
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	TTWO UW Equity	US	USD	0.40%
TARGET CORP	TGT UN Equity	US	USD	0.38%
FIRST SOLAR INC	FSLR UW Equity	US	USD	0.36%
INTERNATIONAL PAPER CO	IP UN Equity	US	USD	0.36%
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	MDLZ UW Equity	US	USD	0.34%
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	SBAC UW Equity	US	USD	0.32%
DOLLAR TREE	DLTR UW Equity	US	USD	0.27%
WORKDAY INC	WDAY UW Equity	US	USD	0.27%
DTE ENERGY CO	DTE UN Equity	US	USD	0.22%
VERISK ANALYTICS INC	VRSK UW Equity	US	USD	0.22%
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	VRTX UW Equity	US	USD	0.22%
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	PM UN Equity	US	USD	0.19%
TRADEWEB MARKETS INC	TW UW Equity	US	USD	0.17%
MARTIN MARIETTA MATERIALS	MLM UN Equity	US	USD	0.14%
ACCENTURE PLC-CL A	ACN UN Equity	IE	USD	0.14%
SALESFORCE INC	CRM UN Equity	US	USD	0.11%
AUTOMATIC DATA PROCESSING	ADP UW Equity	US	USD	0.09%
NETAPP INC	NTAP UW Equity	US	USD	0.08%
PALO ALTO NETWORKS INC	PANW UW Equity	US	USD	0.07%
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	MKC UN Equity	US	USD	0.06%
BOOKING HOLDINGS INC	BKNG UW Equity	US	USD	0.03%
ABBOTT LABORATORIES	ABT UN Equity	US	USD	0.02%
UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH UN Equity	US	USD	0.02%

HINWEISE

© Solactive AG, 2025. 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.

Der Index wurde am 08.03.2016 gestartet. Alle Informationen, einschließlich der Indexstände, die für ein beliebiges Datum oder einen beliebigen Zeitraum vor dem Startdatum bereitgestellt werden, wurden im Wege einer hypothetischen Rückrechnung (sogenannter „Back-Test") ermittelt. Eine auf diese Weise ermittelte Wertentwicklung des Index in der Vergangenheit ist keine tatsächliche, sondern eine hypothetische Wertentwicklung. Die zum Zwecke des Back-Tests vorgenommenen Berechnungen basieren auf der gleichen oder im Wesentlichen der gleichen Methodik, die bei der Auflegung des Index galt. Ein Back-Test bedeutet, dass während des Zeitraums des Back-Tests zu keinem Zeitpunkt eine tatsächliche Anlage in Finanzinstrumente möglich war, die eine Abbildung der Wertentwicklung des Index ermöglicht hätten, und dass daher jeder Vergleich rein hypothetisch ist. Die Methodik und das Modell für die Berechnung des Index für den Zeitraum des Back-Tests wurden mit dem Vorteil der Rückschau entwickelt. Tatsächlich ist es nicht möglich, mit dem Vorteil der Rückschau zu investieren, und deshalb ist dieser Wertentwicklungsvergleich rein theoretisch.

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.