

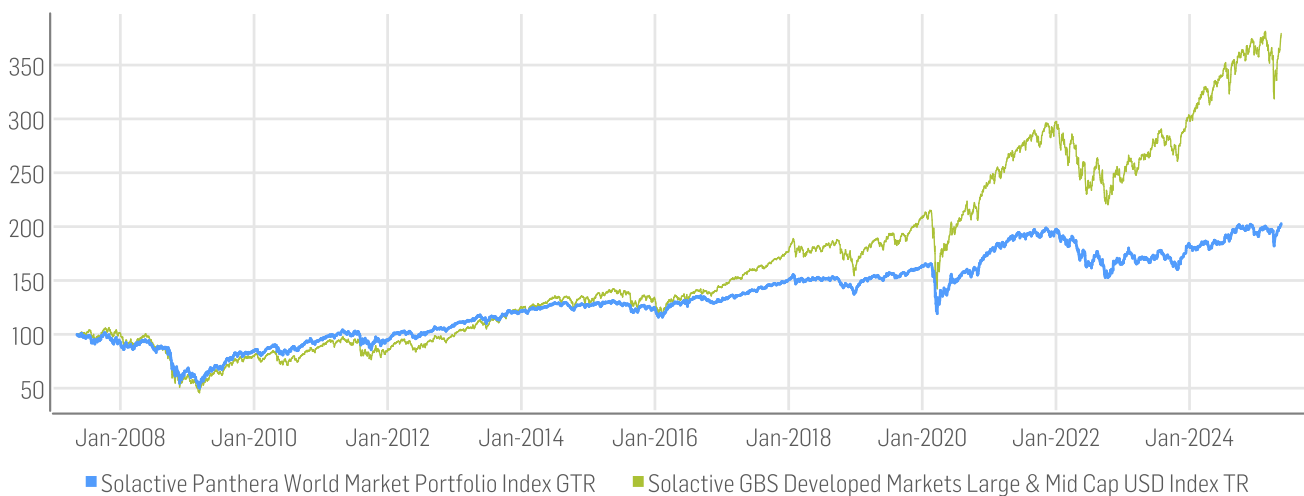
# FACTSHEET - STAND 16.05.2025

## Solactive Panthera World Market Portfolio Index GTR

### BESCHREIBUNG

The Solactive Panthera World Market Portfolio Index is based on the estimation of the global capital stock that involves all identifiable and measurable financial and non-financial assets in the world economy. The index intends to provide a natural benchmark for a multi-asset portfolio by covering 11 asset classes serving as a proxy for the global market portfolio. The Index is calculated as a Price Return, Net Total Return and Gross Total Return Index in USD.

### HISTORISCHE WERTENTWICKLUNG



### STAMMDATEN

ISIN / WKN	DE000SLA3L15 / SLA3L1	Basiswert / Basisdatum	100 Points / 09.05.2007
Bloomberg / Reuters	.SOLPWMPG	Aktueller Stand	202.89
Index Berechner	Solactive AG	Dividenden	Reinvested (Total Return Index)
Index Typ	Total Return	Berechnung	09:00am to 10:30pm (CET), every 15 seconds
Index Wahrung	USD	Historie	Available daily back to 09.05.2007
Index Komponenten	74		

FACTSHEET - STAND 16.05.2025  
Solactive Panthera World Market Portfolio Index GTR

**KENNZAHLEN**

USD	30T	90T	180T	360T	lfd. J	Seit Auflage
Performance	5.97%	1.34%	2.87%	8.49%	4.83%	102.89%
Performance (p.a.)						4.00%
Volatilität (p.a.)	7.02%	12.71%	10.53%	9.22%	11.30%	13.70%
Hoch	202.89	202.89	202.89	202.89	202.89	202.89
Tief	191.46	181.99	181.99	181.99	181.99	49.99
Sharpe Ratio*	14.00	0.10	0.15	0.47	0.82	-0.02
Max. Drawdown	-0.41%	-9.27%	-10.03%	-10.03%	-9.27%	-50.77%
VaR 95 \ 99				-14.5% \ -32.8%		-19.0% \ -42.6%
CVaR 95 \ 99				-24.4% \ -43.0%		-34.4% \ -64.7%

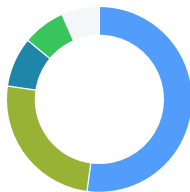
\* Bis einschließlich 31. Dezember 2021 werden ex-post Sharpe Ratios mittels des der Währung entsprechenden und laufzeitenkonkurrenten LIBOR-Satzes berechnet. Ab 3. Januar 2022 werden die Sharpe Ratios über den relevanten risikolosen overnight-Satz berechnet, also SONIA (Britisches Pfund), SOFR (US Dollar)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

**KENNZAHLEN - GBS - Solactive GBS Developed Markets Large & Mid Cap USD Index TR**

USD	30T	90T	180T	360T	lfd. J	Seit Auflage
Performance	11.61%	-0.19%	5.35%	13.02%	5.12%	279.33%
Performance (p.a.)						7.68%
Volatilität (p.a.)	14.62%	24.13%	18.51%	15.50%	20.49%	16.87%
Hoch	2418.36	2430.53	2430.53	2430.53	2430.53	2430.53
Tief	2140.77	2031.80	2031.80	2031.80	2031.80	291.48
Sharpe Ratio*	18.91	-0.21	0.37	0.58	0.49	0.20
Max. Drawdown	-1.45%	-16.41%	-16.41%	-16.41%	-16.41%	-56.99%
VaR 95 \ 99				-23.8% \ -50.5%		-25.3% \ -50.5%
CVaR 95 \ 99				-39.3% \ -76.8%		-42.3% \ -76.4%

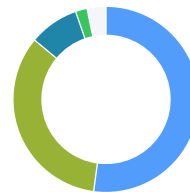
**WÄHRUNGSaufTEILUNG**

- USD 52.1%
- CHF 25.2%
- HKD 8.7%
- EUR 7.4%
- Andere 6.6%



**LÄNDERaufTEILUNG**

- US 52.1%
- IE 33.9%
- HK 8.7%
- CA 2.0%
- Andere 3.3%



### TOP KOMponentEN 16.05.2025

Unternehmen	Ticker	Land	Wahrung	Gewicht
SPDR MSCI WORLD SMALL CAP UCITS ETF	WOSC SE Equity	IE	CHF	23.80%
ISHARES GLOBAL REIT ETF	REET UP Equity	US	USD	16.34%
ISHARES RUSSELL 3000 ETF	IWV UP Equity	US	USD	7.52%
ICBC CSOP BLOOMBERG CHINA TREASURY + POLICY BANK BOND INDEX ETF	3199 HK Equity	HK	HKD	6.46%
ISHARES EUR HIGH YIELD CORP BOND UCITS ETF EUR DIST	IHYG LN Equity	IE	EUR	5.61%
ISHARES U.S. FINANCIALS ETF	IYF UP Equity	US	USD	5.20%
ISHARES IBOXx HIGH YIELD CORPORATE BOND ETF	HYG UP Equity	US	USD	4.98%
INVESCO CURRENCYSHARES JAPANESE YEN TRUST	FXV UP Equity	US	USD	2.58%
ISHARES 1-3 YEAR TREASURY BO	SHY UQ Equity	US	USD	2.47%
CSOP RMB MONEY MARKET ETF	3122 HK Equity	HK	HKD	2.21%

## 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.

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.