

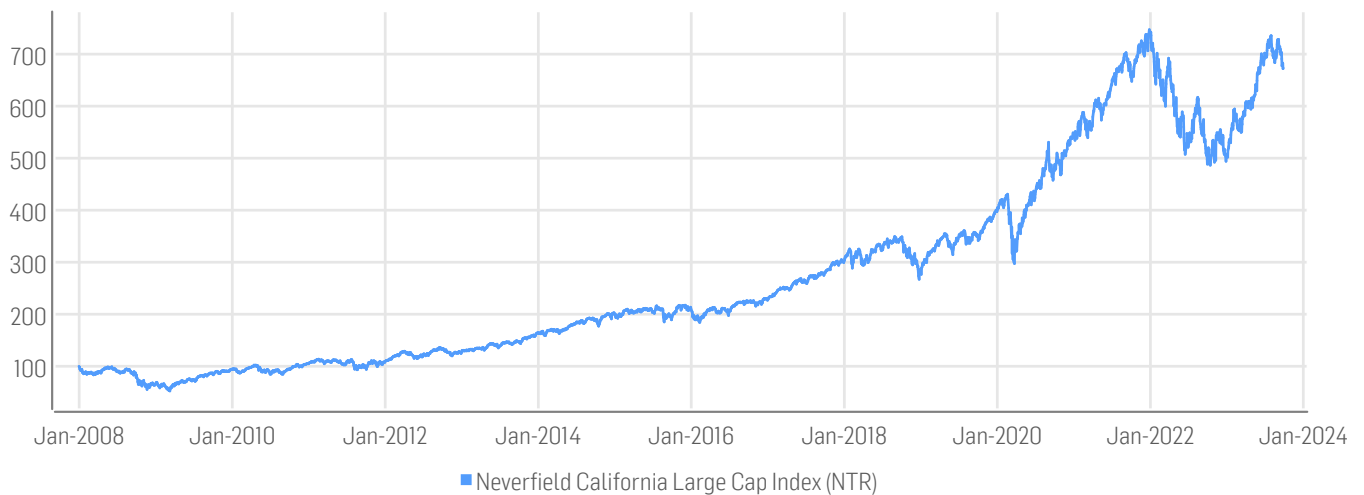
# FACTSHEET - STAND 27.09.2023

## Neverfield California Large Cap Index (NTR)

### BESCHREIBUNG

The Neverfield California Large Cap Index is comprised of the largest companies based in California. The Index is market capitalization weighted and rebalanced semi-annually.

### HISTORISCHE WERTENTWICKLUNG\*



### STAMMDATEN

ISIN / WKN	DE000SLA61S8 / SLA61S	Basiswert / Basisdatum	100 Points / 31.12.2007
Bloomberg / Reuters	- / .NEVCALIN	Aktueller Stand	673.53
Index Berechner	Neverfield Capital	Dividenden	Reinvested (Net Total Return Index)
Index Typ	Net Total Return	Berechnung	09:00am to 04:50pm (EST), every 15 seconds
Index Währung	USD	Historie	Available daily back to 31.12.2007
Index Komponenten	70		

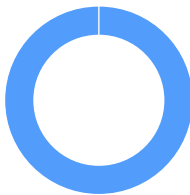
## KENNZAHLEN

USD	30T	90T	180T	360T	lfd. J	Seit Auflage
Performance	-4.24%	-2.55%	11.09%	37.89%	32.95%	573.53%
Performance (p.a.)						12.88%
Volatilität (p.a.)	16.95%	16.45%	16.73%	23.13%	18.66%	23.45%
Hoch	728.46	735.46	735.46	735.46	735.46	747.12
Tief	672.02	672.02	594.08	486.40	501.81	52.38
Sharpe Ratio*	-2.73	-0.93	1.10	1.44	2.22	0.32
Max. Drawdown	-7.75%	-8.63%	-8.63%	-10.99%	-8.63%	-47.62%
VaR 95 \ 99				-32.7% \ -53.6%		-36.6% \ -67.3%
CVaR 95 \ 99				-42.4% \ -57.3%		-57.4% \ -93.6%

\* 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).

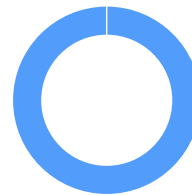
## WÄHRUNGSAUFTeilUNG

• USD 100.0%



## LÄNDERAUFTeilUNG

• US 100.0%



## TOP KOMPONENTEN 27.09.2023

Unternehmen	Ticker	Land	Währung	Gewicht
APPLE INC	AAPL UW Equity	US	USD	24.30%
ALPHABET INC-CL A	GOOGL UW Equity	US	USD	13.97%
NVIDIA CORP	NVDA UW Equity	US	USD	9.02%
META PLATFORMS INC	META UW Equity	US	USD	5.81%
VISA INC-CLASS A SHARES	V UN Equity	US	USD	3.33%
BROADCOM INC	AVGO UW Equity	US	USD	3.06%
CHEVRON CORP	CVX UN Equity	US	USD	3.01%
ORACLE CORP	ORCL UN Equity	US	USD	2.52%
ADOBE INC	ADBE UW Equity	US	USD	2.08%
CISCO SYSTEMS INC	CSCO UW Equity	US	USD	1.98%

## 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](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.