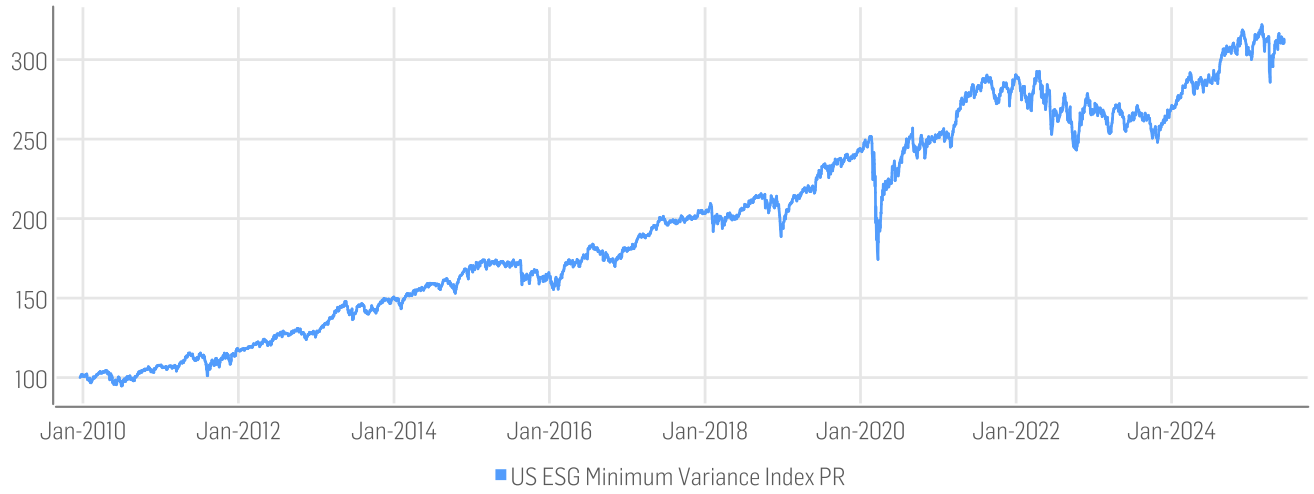
FACTSHEET - À PARTIR DU 13 Jun 2025
US ESG Minimum Variance Index PR

DESCRIPTION

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

PERFORMANCE HISTORIQUE



DONNEES CLES

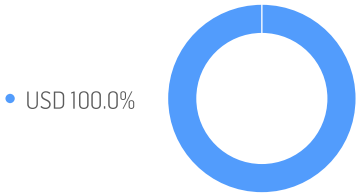
ISIN / WKN	DE000SLA1XQ9 / SLA1XQ	Valeur / Date initiales	100 Points / 08.03.2016
Bloomberg / Reuters	ESGUSMVP Index / .ESGUSMVP	Prix actuel	310.63
Calculateur de l'Indice	Solactive AG	Dividendes	Not included (Price index)
Type d'Indice	Price Return	Calcul	09 :00am to 10 :30pm (CET), every 15 seconds
Devise de l'Indice	USD	Données	Available daily back to 18.12.2009
Composants de l'Indice	87		

STATISTIQUES

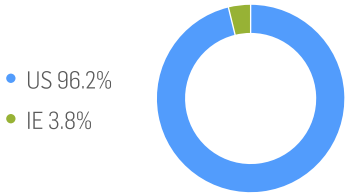
USD	30J	90J	180J	360J	YTD	Depuis sa Création
Performance	1.39%	0.53%	-0.41%	8.28%	2.17%	85.98%
Performance (p.a.)						6.93%
Volatilité (p.a.)	10.85%	19.45%	15.98%	12.53%	16.24%	13.57%
Maxi	316.39	316.39	322.00	322.00	322.00	322.00
Mini	306.36	285.76	285.76	284.87	285.76	167.02
Sharpe Ratio*	1.30	-0.11	-0.32	0.33	0.04	0.19
Max. Drawdown	-2.00%	-9.14%	-11.25%	-11.25%	-11.25%	-30.78%
VaR 95 \ 99				-16.5% \ -30.4%		-19.0% \ -35.4%
CVaR 95 \ 99				-29.5% \ -61.7%		-32.1% \ -64.9%

* Up to 31 December 2021, ex-post Sharpe ratios use as input for the risk free rate term the London Inter-Bank Offered rates in the respective currencies of the index and at a term equal to the observation period. From 3 January 2022 onwards, Sharpe ratios will be / are calculated using as reference risk free rate input the overnight replacement rate for these currencies, namely SONIA (for GBP), SOFR (for USD) and EURIBOR Overnight (for EUR).

EXPOSITION AU RISQUE DE CHANGE



EXPOSITION AU RISQUE-PAYS



PREMIERS COMPOSANTS 13 Jun 2025

Société	Code	Pays	Monnaie	Poids
MCKESSON CORP	MCK UN Equity	US	USD	4.58%
CME GROUP INC	CME UW Equity	US	USD	4.45%
ALTRIA GROUP INC	MO UN Equity	US	USD	3.70%
CENCORA INC	COR UN Equity	US	USD	3.31%
KROGER CO	KR UN Equity	US	USD	3.21%
VERIZON COMMUNICATIONS INC	VZ UN Equity	US	USD	2.71%
AUTOZONE INC	AZO UN Equity	US	USD	2.67%
WASTE MANAGEMENT INC	WM UN Equity	US	USD	2.66%
JOHNSON & JOHNSON	JNJ UN Equity	US	USD	2.53%
CMS ENERGY CORP	CMS UN Equity	US	USD	2.41%
CENTERPOINT ENERGY INC	CNP UN Equity	US	USD	2.34%
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	EW UN Equity	US	USD	2.26%
DUKE ENERGY CORP	DUK UN Equity	US	USD	2.24%
KIMBERLY-CLARK CORP	KMB UW Equity	US	USD	2.21%
AT&T	T UN Equity	US	USD	2.13%

FACTSHEET - À PARTIR DU 13 Jun 2025
US ESG Minimum Variance Index PR

Société	Code	Pays	Monnaie	Poids
KEURIG DR PEPPER INC	KDP UW Equity	US	USD	2.11%
PROGRESSIVE CORP	PGR UN Equity	US	USD	1.94%
GENERAL MILLS INC	GIS UN Equity	US	USD	1.89%
ALPHABET INC-CL A	GOOGL UW Equity	US	USD	1.87%
PFIZER INC	PFE UN Equity	US	USD	1.74%
CLOROX COMPANY	CLX UN Equity	US	USD	1.73%
ALPHABET INC C-SHARES	GOOG UW Equity	US	USD	1.70%
ANSYS INC	ANSS UW Equity	US	USD	1.58%
MICROSOFT CORP	MSFT UW Equity	US	USD	1.57%
KENVUE INC	KVUE UN Equity	US	USD	1.55%
WEC ENERGY GROUP INC	WEC UN Equity	US	USD	1.52%
EXELON CORP	EXC UW Equity	US	USD	1.45%
NVIDIA CORP	NVDA UW Equity	US	USD	1.40%
MCDONALDS CORP	MCD UN Equity	US	USD	1.36%
TJX COMPANIES INC	TJX UN Equity	US	USD	1.19%
WW GRAINGER INC	GWW UN Equity	US	USD	1.18%
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	BAH UN Equity	US	USD	1.14%
AON PLC	AON UN Equity	IE	USD	1.10%
CONSOLIDATED EDISON INC	ED UN Equity	US	USD	1.05%
HUMANA INC	HUM UN Equity	US	USD	1.05%
DEXCOM INC	DXCM UW Equity	US	USD	1.04%
AMERICAN ELECTRIC POWER COMPANY INC	AEP UW Equity	US	USD	1.04%
WILLIS TOWERS WATSON PLC	WTW UW Equity	IE	USD	1.02%
DATADOG INC	DDOG UW Equity	US	USD	0.98%
NVR INC	NVR UN Equity	US	USD	0.92%
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	ADM UN Equity	US	USD	0.90%
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	TTWO UW Equity	US	USD	0.89%
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	FLUT UN Equity	IE	USD	0.88%
CHEVRON CORP	CVX UN Equity	US	USD	0.87%
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	ICE UN Equity	US	USD	0.86%
VEEVA SYSTEMS INC	VEEV UN Equity	US	USD	0.84%
SMURFIT WESTROCK PLC	SW UN Equity	IE	USD	0.79%
CENTENE CORP	CNC UN Equity	US	USD	0.79%
D R HORTON INC	DHI UN Equity	US	USD	0.78%
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	MDLZ UW Equity	US	USD	0.72%
DOLLAR TREE	DLTR UW Equity	US	USD	0.72%
DTE ENERGY CO	DTE UN Equity	US	USD	0.69%
REPUBLIC SERVICES INC	RSG UN Equity	US	USD	0.65%
DIGITAL REALTY TRUST INC	DLR UN Equity	US	USD	0.64%
COCA-COLA CO/THE	KO UN Equity	US	USD	0.62%
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	LPLA UW Equity	US	USD	0.62%
F5 INC	FFIV UW Equity	US	USD	0.61%
JABIL INC	JBL UN Equity	US	USD	0.59%
SCHWAB (CHARLES) CORP	SCHW UN Equity	US	USD	0.55%

FACTSHEET - À PARTIR DU 13 Jun 2025
US ESG Minimum Variance Index PR

Société	Code	Pays	Monnaie	Poids
PALO ALTO NETWORKS INC	PANW UW Equity	US	USD	0.54%
CARDINAL HEALTH INC	CAH UN Equity	US	USD	0.54%
ABBOTT LABORATORIES	ABT UN Equity	US	USD	0.53%
BJS WHOLESALE CLUB HOLDINGS	BJ UN Equity	US	USD	0.50%
CIGNA GROUP	CI UN Equity	US	USD	0.46%
WORKDAY INC	WDAY UW Equity	US	USD	0.41%
FOX CORP CLASS A (NEW)	FOXA UW Equity	US	USD	0.40%
INTERNATIONAL PAPER CO	IP UN Equity	US	USD	0.40%
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	CMG UN Equity	US	USD	0.36%
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	MKC UN Equity	US	USD	0.35%
DELL TECHNOLOGIES INC - C	DELL UN Equity	US	USD	0.35%
CISCO SYSTEMS INC	CSCO UW Equity	US	USD	0.31%
UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH UN Equity	US	USD	0.29%
ELEVANCE HEALTH INC	ELV UN Equity	US	USD	0.29%
TRADEWEB MARKETS INC	TW UW Equity	US	USD	0.26%
EXPEDITORS INTL WASH INC	EXPD UN Equity	US	USD	0.25%
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	GWRE UN Equity	US	USD	0.23%
MARTIN MARIETTA MATERIALS	MLM UN Equity	US	USD	0.19%
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	BMY UN Equity	US	USD	0.19%
M & T BANK CORP	MTB UN Equity	US	USD	0.13%
EQT CORP	EQT UN Equity	US	USD	0.13%
VULCAN MATERIALS CO	VMC UN Equity	US	USD	0.10%
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	SBAC UW Equity	US	USD	0.07%
MERCK & CO. INC.	MRK UN Equity	US	USD	0.05%
EMCOR GROUP INC	EME UN Equity	US	USD	0.05%
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	PM UN Equity	US	USD	0.04%
ACCENTURE PLC-CL A	ACN UN Equity	IE	USD	0.02%
NETAPP INC	NTAP UW Equity	US	USD	0.02%

AVERTISSEMENT

© Solactive AG, 2025. Tous droits réservés.

Les informations contenues dans cette fiche technique sont impersonnelles, non adaptées aux besoins d'une personne, d'une entité ou d'un groupe de personnes, et sont fournies à titre informatif uniquement. Les informations contenues ici ont été obtenues à partir de sources publiques réputées fiables, mais aucune déclaration ou garantie, explicite ou implicite, n'est faite quant à l'exactitude ou l'exhaustivité de ces informations, et elles ne doivent pas être considérées comme telles. Le contenu est fourni "tel quel". Solactive AG n'assume aucune responsabilité pour les erreurs ou les pertes découlant de l'utilisation de cette fiche technique ou de l'une des informations ou données qui y sont contenues. En aucun cas, Solactive AG ne pourra être tenu responsable envers une partie quelconque de tout dommage direct, indirect, matériel, exemplaire, compensatoire, punitif, spécial ou consécutif, frais, dépenses, honoraires d'avocat ou pertes (y compris, sans limitation, perte de revenus ou de bénéfices et frais d'opportunité) liés à l'utilisation des fiches et de leur contenu, même si l'avertissement de ces dommages à été signalée.

Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice. L'exposition aux actifs représentés par un indice est possible grâce à des instruments financiers investissables qui cherchent à fournir un rendement basé sur la performance d'un indice. Une décision d'investir dans de tels instruments financiers ne doit pas être prise en se basant sur les déclarations présentées dans ce document. Les investisseurs potentiels sont invités à investir dans un tel instrument financier uniquement après avoir soigneusement pris en compte les risques associés à ces instruments financiers, détaillés dans un mémorandum d'offre ou un document similaire préparé par l'émetteur de l'instrument financier ou du véhicule.

Les instruments financiers ne sont pas parrainés, promus, vendus ou soutenus de quelque manière que ce soit par Solactive AG, et Solactive AG n'offre aucune garantie ou assurance, explicite ou implicite, concernant les résultats de l'utilisation de l'indice et/ou de la marque commerciale de l'indice, ni concernant le niveau de l'indice à tout moment ou sous quelque autre aspect que ce soit. Solactive AG ne garantit en aucune manière que les instruments financiers basés sur l'indice suivront avec précision la performance de l'indice ou procureront des rendements d'investissement positifs. Solactive AG n'est pas un conseiller en investissement et rien dans cette fiche technique ne constitue une recommandation de la part de Solactive AG d'investir des capitaux dans des instruments financiers, ni ne représente d'aucune manière une assurance ou une opinion de Solactive AG concernant tout investissement dans un instrument financier. L'inclusion d'une valeur mobilière dans un indice ne constitue pas une recommandation de Solactive AG d'acheter, de vendre ou de conserver cette valeur mobilière, et cela ne doit pas être considéré comme un conseil en investissement.

L'indice a été lancé le 08 Mar 2016. Toutes les informations, y compris les niveaux de l'indice, fournies pour toute date ou période antérieure à la date de lancement sont des simulations. La performance rétrospective n'est pas une performance réelle, mais hypothétique. Les calculs rétrospectifs sont basés sur la même méthodologie, ou fondamentalement la même, qui était en vigueur au moment du lancement de l'indice. Un calcul rétrospectif signifie qu'aucun investissement réel permettant de suivre la performance de l'indice n'a été possible à aucun moment pendant la période du calcul rétrospectif, et que par conséquent, toute comparaison est purement hypothétique. La méthodologie et le modèle utilisés pour le calcul et le calcul rétrospectif de l'indice ont été élaborés avec l'avantage de la connaissance acquise par la suite. En réalité, il n'est pas possible d'investir en ayant cet avantage, et donc cette comparaison de performance est purement théorique.

Les performances passées ne doivent pas être considérées comme une indication ou une garantie de résultats futurs. Les graphiques et les diagrammes sont fournis à des fins illustratives.

Ce service d'information est proposé exclusivement par Solactive AG, Platz der Einheit 1, D-60327 Frankfurt am Main | E-Mail : indexing@solactive.com

"Solactive", "Solactive GBS", "German Index Engineering" et le logo sont des marques déposées de Solactive AG.

Les informations contenues dans ce document ne constituent pas un avis fiscal, juridique ou d'investissement. La fiche technique est la propriété de Solactive AG. Son contenu ne peut être modifié, reproduit, redistribué ou stocké, en totalité ou en partie, dans un système de récupération, sans le consentement écrit préalable de Solactive AG.