

FACTSHEET - STAND 22.02.2024

Europe US Selection Long Exposure

HISTORISCHE WERTENTWICKLUNG*



STAMMDATEN

ISIN / WKN	DE000SLA0YP1 / SLA0YP	Basiswert / Basisdatum	1000 Points / 07.04.2015
Bloomberg / Reuters	EUUSUNL Index / .EUUSUNL	Aktueller Stand	603.78
Index Berechner	Solactive AG	Dividenden	not included (Price return)
Index Typ	Price Return	Berechnung	08:00am to 22:30pm (CET), end of day
Index Währung	EUR	Historie	Available daily back to 07.04.2015
Index Komponenten	45		

KENNZAHLEN

EUR	30T	90T	180T	360T	lfd. J	Seit Auflage
Performance	2.18%	4.09%	6.11%	-1.63%	3.48%	-40.67%
Performance (p.a.)						-5.71%
Volatilität (p.a.)	6.47%	6.64%	7.16%	8.27%	7.14%	14.78%
Hoch	603.78	603.78	603.78	613.75	603.78	1031.00
Tief	590.87	575.28	563.77	558.74	583.46	522.53
Sharpe Ratio*	4.05	2.07	1.24	-0.67	3.03	-0.65
Max. Drawdown	-1.30%	-1.99%	-4.57%	-8.96%	-1.99%	-49.32%
VaR 95 \ 99				-14.9% \ -22.1%		-22.6% \ -42.7%
CVaR 95 \ 99				-18.8% \ -23.0%		-37.5% \ -68.8%

* 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

- EUR 29.8%
- USD 24.3%
- GBP 24.0%
- CHF 13.3%
- Andere 8.7%



LÄNDERAUFTeilUNG

- GB 24.8%
- US 23.5%
- CH 13.3%
- FR 9.4%
- Andere 29.0%



TOP KOMPONENTEN 22.02.2024

Unternehmen	Ticker	Land	Währung	Gewicht
MERCEDES-BENZ GROUP AG	MBG GY Equity	DE	EUR	5.48%
CAIXABANK SA	CABK SQ Equity	ES	EUR	5.28%
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	BATS LN Equity	GB	GBP	5.10%
ORANGE SA	ORA FP Equity	FR	EUR	4.97%
IMPERIAL BRANDS PLC	IMB LN Equity	GB	GBP	4.91%
NORDEA BANK ABP	NDA FH Equity	FI	EUR	4.85%
SWISSCOM AG	SCMN SE Equity	CH	CHF	4.84%
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	BMV UN Equity	US	USD	4.66%
ESSITY AB CLASS B	ESSITYB SS Equity	SE	SEK	4.63%
VODAFONE GROUP PLC	VOD LN Equity	GB	GBP	4.42%
ENGIE SA	ENGI FP Equity	FR	EUR	4.38%
EQUINOR ASA	EQNR NO Equity	NO	NOK	4.02%
ABBVIE INC	ABBV UN Equity	US	USD	3.69%

FACTSHEET - STAND 22.02.2024
Europe US Selection Long Exposure

Unternehmen	Ticker	Land	Währung	Gewicht
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	RKT LN Equity	GB	GBP	3.59%
COCA-COLA CO/THE	KO UN Equity	US	USD	3.50%
VERIZON COMMUNICATIONS INC	VZ UN Equity	US	USD	3.32%
UNILEVER PLC	ULVR LN Equity	GB	GBP	3.06%
SGS SA	SGSN SE Equity	CH	CHF	2.97%
COMPASS GROUP PLC	CPG LN Equity	GB	GBP	2.93%
GIVAUDAN SA	GIVN SE Equity	CH	CHF	2.88%
HENKEL AG & CO KGAA PREF	HEN3 GY Equity	DE	EUR	2.83%
NETFLIX INC	NFLX UW Equity	US	USD	2.77%
PFIZER INC	PFE UN Equity	US	USD	2.39%
ROCHE HOLDING AG	ROG SE Equity	CH	CHF	2.05%
ASM INTERNATIONAL NV	ASM NA Equity	NL	EUR	1.49%
UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH UN Equity	US	USD	1.40%
NVIDIA CORP	NVDA UW Equity	US	USD	0.99%
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	CCEP UW Equity	GB	USD	0.79%
APPLIED MATERIALS INC	AMAT UW Equity	US	USD	0.75%
LOGITECH INTERNATIONAL SA	LOGN SE Equity	CH	CHF	0.56%
JERONIMO MARTINS SGPS SA	JMT PL Equity	PT	EUR	0.47%
NESTLE SA	NESN SE Equity	CH	CHF	0.00%
SAMPO OYJ CLASS A	SAMPO FH Equity	FI	EUR	0.00%
COSTCO WHOLESALE CORP	COST UW Equity	US	USD	0.00%
AVIVA PLC	AV/ LN Equity	GB	GBP	0.00%
MICROSOFT CORP	MSFT UW Equity	US	USD	0.00%
ADVANCED MICRO DEVICES	AMD UW Equity	US	USD	0.00%
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	IBM UN Equity	US	USD	0.00%
DANSKE BANK A/S	DANSKE DC Equity	DK	DKK	0.00%
ROYAL AHOLD DELHAIZE NV	AD NA Equity	NL	EUR	0.00%
PEPSICO INC	PEP UW Equity	US	USD	0.00%
AT&T	T UN Equity	US	USD	0.00%
CISCO SYSTEMS INC	CSCO UW Equity	US	USD	0.00%
SANOFI SA	SAN FP Equity	FR	EUR	0.00%
HSBC HOLDINGS PLC	HSBA LN Equity	GB	GBP	0.00%

HINWEISE

© Solactive AG, 2024. 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 07.04.2015 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.