

FACTSHEET - STAND 22.02.2024

Europe US Qualité Long Exposure

HISTORISCHE WERTENTWICKLUNG*



STAMMDATEN

ISIN / WKN	DE000SLA1LL5 / SLA1LL	Basiswert / Basisdatum	1000 Points / 23.06.2005
Bloomberg / Reuters	EUQUSUNL Index / .EUQUSUNL	Aktueller Stand	1714.99
Index Berechner	Solactive AG	Dividenden	not included
Index Typ	Equity Index	Berechnung	08:30am to 10:50pm (CET), every 15 seconds
Index Währung	EUR	Historie	Available daily back to 23.06.2005
Index Komponenten	38		

KENNZAHLEN

EUR	30T	90T	180T	360T	lfd. J	Seit Auflage
Performance	2.30%	4.03%	4.42%	-3.93%	2.23%	71.50%
Performance (p.a.)						2.93%
Volatilität (p.a.)	7.82%	7.37%	8.47%	9.10%	8.24%	14.45%
Hoch	1714.99	1714.99	1715.13	1802.22	1714.99	1837.23
Tief	1676.45	1634.34	1586.75	1586.75	1659.83	833.12
Sharpe Ratio*	3.58	1.83	0.62	-0.87	1.44	-0.07
Max. Drawdown	-1.40%	-2.90%	-7.48%	-11.96%	-2.90%	-43.65%
VaR 95 \ 99				-16.3% \ -22.2%		-22.2% \ -42.8%
CVaR 95 \ 99				-20.1% \ -24.5%		-35.2% \ -60.6%

* 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

- EUR 51.7%
- USD 21.2%
- GBP 13.1%
- DKK 5.3%
- Andere 8.7%



LÄNDERAUFTEILUNG

- US 17.5%
- DE 14.6%
- GB 13.1%
- FR 10.9%
- Andere 43.9%



TOP KOMPONENTEN 22.02.2024

Unternehmen	Ticker	Land	Währung	Gewicht
CARLSBERG AS CLASS B	CARLB DC Equity	DK	DKK	4.45%
MERCEDES-BENZ GROUP AG	MBG GY Equity	DE	EUR	4.44%
VOLKSWAGEN AG PREF	VOW3 GY Equity	DE	EUR	4.25%
OMV AG	OMV AV Equity	AT	EUR	4.14%
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	BATS LN Equity	GB	GBP	4.13%
ROYAL AHOLD DELHAIZE NV	AD NA Equity	NL	EUR	4.10%
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	PXD UN Equity	US	USD	4.06%
TIETOEVRV OYJ	TIETO FH Equity	FI	EUR	4.05%
ALTRIA GROUP INC	MO UN Equity	US	USD	4.03%
ORANGE SA	ORA FP Equity	FR	EUR	4.03%
GENERAL MILLS INC	GIS UN Equity	US	USD	4.03%
SWISSCOM AG	SCMN SE Equity	CH	CHF	3.92%
PFIZER INC	PFE UN Equity	US	USD	3.87%

FACTSHEET - STAND 22.02.2024
Europe US Qualität Long Exposure

Unternehmen	Ticker	Land	Währung	Gewicht
VODAFONE GROUP PLC	VOD LN Equity	GB	GBP	3.77%
AMCOR PLC	AMCR UN Equity	JE	USD	3.75%
ENI SPA	ENI IM Equity	IT	EUR	3.66%
KESKO OYJ CLASS B	KESKOB FH Equity	FI	EUR	3.54%
VOLKSWAGEN AG	VOW GY Equity	DE	EUR	3.48%
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	RKT LN Equity	GB	GBP	3.35%
EQUINOR ASA	EQNR NO Equity	NO	NOK	3.26%
JDE PEETS BV	JDEP NA Equity	NL	EUR	2.72%
CARREFOUR SA	CA FP Equity	FR	EUR	2.66%
SODEXO SA	SW FP Equity	FR	EUR	2.52%
ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS SA	ACS SQ Equity	ES	EUR	2.01%
BAE SYSTEMS PLC	BA/ LN Equity	GB	GBP	1.85%
PUBLICIS GROUPE SA	PUB FP Equity	FR	EUR	1.64%
MTU AERO ENGINES AG	MTX GY Equity	DE	EUR	1.62%
SNAP-ON INC	SNA UN Equity	US	USD	1.09%
JERONIMO MARTINS SGPS SA	JMT PL Equity	PT	EUR	1.06%
PRADA SPA	1913 HK Equity	IT	HKD	1.01%
PLUXEE INTERNATIONAL SAS	PLX FP Equity	NL	EUR	0.91%
AP MOLLER MAERSK AS CLASS B	MAERSKB DC Equity	DK	DKK	0.88%
BAYER AG	BAYN GY Equity	DE	EUR	0.84%
YARA INTERNATIONAL ASA	YAR NO Equity	NO	NOK	0.47%
INTERNATIONAL PAPER CO	IP UN Equity	US	USD	0.41%
CONAGRA BRANDS INC	CAG UN Equity	US	USD	0.00%
AP MOLLER MAERSK A/S ORD A	MAERSKA DC Equity	DK	DKK	0.00%
PACCAR INC	PCAR UW Equity	US	USD	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 23.06.2005 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.