

FACTSHEET - STAND 22.02.2024

F.A.Z. Euro Finanz Index

BESCHREIBUNG

Der F.A.Z. Euro Finanz Index bildet die Kursentwicklung von 25 Unternehmen ab, deren Hauptgeschäftstätigkeit in der Finanzbranche liegt, die ihren Hauptsitz in einem Land der Eurozone haben und an einer anerkannten Börse in der Eurozone gelistet sind. Der Finanzsektor umfasst sowohl Banken als auch Finanzdienstleister, Versicherungen und REITs. Aus jedem Land der Eurozone wird zunächst das grösste Unternehmen aus dem Finanzsektor ausgewählt und anschliessend weitere Mitglieder bis zu einer Höchstzahl von 25 aufgenommen. Der F.A.Z. Euro Finanz Index wird als Kursindex in EUR berechnet und einmal im Jahr angepasst.

HISTORISCHE WERTENTWICKLUNG*



STAMMDATEN

ISIN / WKN	DE000SLA1SF2 / SLA1SF	Basiswert / Basisdatum	100 Points / 19.09.2011
Bloomberg / Reuters	FAZESF Index / .FAZESF	Aktueller Stand	203.27
Index Berechner	Solactive AG	Dividenden	Not included (Price index)
Index Typ	Industry / Sector	Berechnung	09:00am to 06:30pm (CET), every 60 seconds
Index Währung	EUR	Historie	Available daily back to 19.09.2011
Index Komponenten	26		

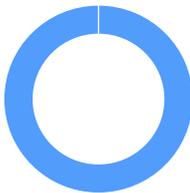
KENNZAHLEN

EUR	30T	90T	180T	360T	lfd. J	Seit Auflage
Performance	3.09%	5.22%	15.58%	10.99%	2.28%	102.62%
Performance (p.a.)						5.85%
Volatilität (p.a.)	12.90%	11.29%	13.77%	18.52%	12.93%	25.65%
Hoch	203.27	203.27	203.27	203.27	203.27	203.27
Tief	195.62	192.47	173.90	156.95	195.62	82.33
Sharpe Ratio*	3.18	1.69	2.20	0.39	0.95	0.08
Max. Drawdown	-3.08%	-3.19%	-5.12%	-16.07%	-3.19%	-58.45%
VaR 95 \ 99				-25.5% \ -61.1%		-39.2% \ -70.2%
CVaR 95 \ 99				-48.6% \ -96.2%		-61.3% \ -103.4%

* 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).

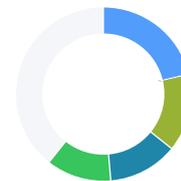
WÄHRUNGSaufTEILUNG

• EUR 100.0%



LÄNDERaufTEILUNG

- DE 21.3%
- FR 14.5%
- IT 12.9%
- ES 12.0%
- Andere 39.3%



TOP KOMPONENTEN 22.02.2024

Unternehmen	Ticker	Land	Währung	Gewicht
AROUNDTOWN SA	AT1 GY Equity	LU	EUR	5.68%
VONOVIA SE	VNA GY Equity	DE	EUR	5.02%
UNICREDIT SPA	UCG IM Equity	IT	EUR	4.86%
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	BBVA SQ Equity	ES	EUR	4.50%
DEUTSCHE BANK AG	DBK GY Equity	DE	EUR	4.32%
EUROBANK ERGASIAS SERVICES AND HOLDINGS	EUROB GA Equity	GR	EUR	4.27%
BANCO COMERCIAL PORTUGUES SA	BCP PL Equity	PT	EUR	4.26%
ERSTE GROUP BANK AG	EBS AV Equity	AT	EUR	4.19%
MUNICH REINSURANCE COMPANY	MUV2 GY Equity	DE	EUR	4.14%
INTESA SANPAOLO SPA	ISP IM Equity	IT	EUR	4.09%
ALLIANZ SE	ALV GY Equity	DE	EUR	4.06%
AXA SA	CS FP Equity	FR	EUR	4.02%
CREDIT AGRICOLE SA	ACA FP Equity	FR	EUR	3.93%

Unternehmen	Ticker	Land	Währung	Gewicht
ASSICURAZIONI GENERALI SPA	G IM Equity	IT	EUR	3.91%
BANCO SANTANDER SA	SAN SQ Equity	ES	EUR	3.85%

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.

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.