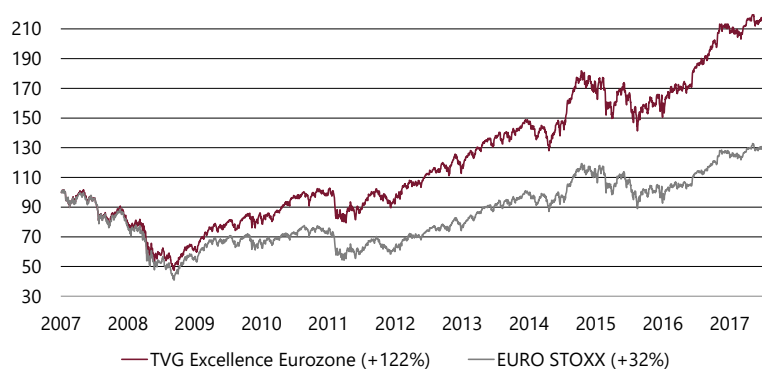


# TVG Excellence Eurozone Index

Der TVG Excellence Eurozone Index setzt sich aus den 100 besten Mitgliedern des EURO STOXX Index nach dem TVG Quality Score zusammen. Dieser misst die Wettbewerbsstärke von Unternehmen anhand von Parametern wie Corporate Governance, Image and Brand, Innovation Capital, Corporate Risk, External Stakeholders und Human Capital. The Value Group konnte in einer Reihe von Studien nachweisen, dass Strategien die auf dem TVG Quality Score basieren, eine signifikante Outperformance erzielen. Eine Gewichtung der Mitglieder nach Fundamentalfaktoren sorgt darüber hinaus für ein verbessertes Risiko-Rendite-Profil.

## 10-JAHRES RENDITE



## KENNZAHLEN

|                | TVG EXCELLENCE | EURO STOXX |
|----------------|----------------|------------|
| ALPHA          | 4,78%          |            |
| BETA           | 0,9            | 1          |
| ANNUAL RETURN  | 10,15%         | 3,71%      |
| STD. DEVIATION | 20,14%         | 21,88%     |
| TRACKING ERROR | 4,27%          |            |
| SHARPE RATIO   | 0,49           | 0,16       |
| TREYNOR RATIO  | 11,0%          | 3,51%      |
| INFORM. RATIO  | 101,2%         |            |

## RENDITE

|              | TVG EXCELLENCE | EURO STOXX |
|--------------|----------------|------------|
| 1 JAHR       | 19,35%         | 18,24%     |
| 3 JAHRE      | 39,07%         | 27,42%     |
| 5 JAHRE      | 92,63%         | 73,51%     |
| 10 JAHRE     | 146,24%        | 47,64%     |
| SEIT AUFLAGE | 122,01%        | 32,36%     |

## INDEXPROFIL

- **Benchmark:**  
EURO STOXX
- **Asset Klasse:**  
Aktien
- **Region:**  
Eurozone
- **Anzahl Mitglieder:**  
100
- **Währung:**  
Euro
- **Umschichtungsdatum:**  
30. Juni
- **Screening:**  
Nein
- **Selektion:**  
TVG Quality Score
- **Gewichtung:**  
Fundamental
- **Berechnungsbeginn:**  
30. Juni 2007

# TVG Excellence Eurozone Index

## BRANCHENGEWICHTUNG

| BRANCHE        | GEWICHTUNG |
|----------------|------------|
| HAUSHALTSGÜTER | 16,6%      |
| AUTOMOBIL      | 11,9%      |
| TECHNOLOGIE    | 11,7%      |
| INDUSTRIE      | 11,3%      |
| BANKEN         | 7,5%       |
| GESUNDHEIT     | 6,4%       |
| MEDIEN         | 5,9%       |
| BAU            | 5,6%       |
| SONSTIGE       | 23,1%      |

## LÄNDERGEWICHTUNG

| LAND        | GEWICHTUNG |
|-------------|------------|
| FRANKREICH  | 40,2%      |
| DEUTSCHLAND | 29,0%      |
| NIEDERLANDE | 9,6%       |
| BELGIEN     | 6,1%       |
| IRLAND      | 5,4%       |
| SPANIEN     | 5,0%       |
| FINNLAND    | 3,2%       |
| ITALIEN     | 1,0%       |
| PORTUGAL    | 0,6%       |

## TOP HOLDINGS

| UNTERNEHMEN          | GEWICHTUNG |
|----------------------|------------|
| DASSAULT SYSTEMES SA | 4,1%       |
| HENKEL AG & CO.KGAA  | 3,2%       |
| PEUGEOT SA           | 3,1%       |
| CREDIT AGRICOLE SA   | 2,6%       |
| SCHAEFFLER           | 2,6%       |
| KINGSPAN GROUP PLC.  | 2,5%       |
| PLASTIC OMNIUM       | 2,5%       |
| HERMES INTERNATIONAL | 2,4%       |
| KBC GROEP NV         | 2,2%       |
| BMW AG               | 2,2%       |
| SONSTIGE             | 72,8%      |

## KONTAKT

The Value Group GmbH

Dr. Claus Dürndorfer

Freibadstraße 30

81543 München

Tel: 089 / 287 298 4

Fax: 089 / 287 298 79

[claus.duerndorfer@thevaluegroup.de](mailto:claus.duerndorfer@thevaluegroup.de)

[www.thevaluegroup.de](http://www.thevaluegroup.de)