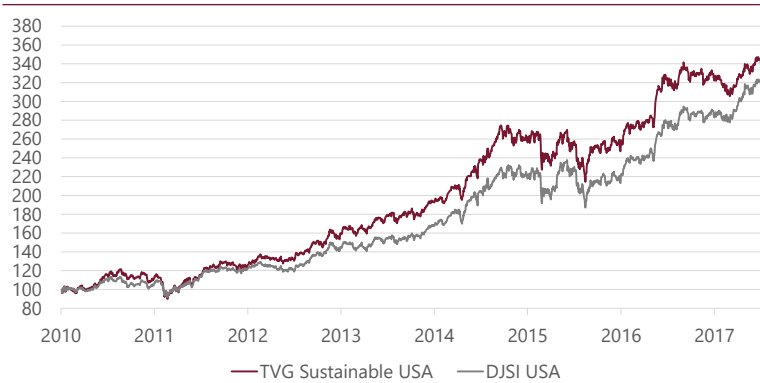


# TVG Sustainable USA Index

Das Ziel des **TVG Sustainable USA Index** ist es, unter Berücksichtigung ethischer und nachhaltiger Anlagekriterien eine langfristige Outperformance zu erzielen. Hierzu werden zuerst aus den Mitgliedern des S&P 500 Index Unternehmen herausgefiltert, die entweder in nicht-nachhaltigen Sektoren tätig sind, oder die durch unethische Verhaltensweisen aufgefallen sind. Aus den verbleibenden Unternehmen werden die 100 nachhaltigsten nach dem **ESG Score** in den Index aufgenommen. Eine Gewichtung der Mitglieder nach Fundamentalfaktoren sorgt darüber hinaus für ein optimiertes Risiko-Rendite-Profil.

## 10-JAHRES RENDITE



## KENNZAHLEN

	TVG SUSTAINABLE	DJSI USA
ALPHA	0,21%	
BETA	1,04	1
ANNUAL RETURN	16,99%	16,27%
STD. DEVIATION	17,28%	15,85%
TRACKING ERROR	5,25%	
SHARPE RATIO	0,97	1,01
TREYNOR RATIO	16,15%	16,07%
INFORM. RATIO	16,20%	

## RENDITE

	TVG SUSTAINABLE	DJSI USA
1 JAHR	4,0%	14,5%
3 JAHRE	37,0%	53,7%
5 JAHRE	144,4%	154,9%
SEIT AUFLAGE	246,7%	230,2%

## INDEXPROFIL

- **Benchmark:**  
DJSI USA
- **Asset Klasse:**  
Aktien
- **Region:**  
USA
- **Anzahl Mitglieder:**  
100
- **Währung:**  
Euro
- **Umschichtungsdatum:**  
30. Juni
- **Screening:**  
Nachhaltigkeit
- **Selektion:**  
ESG Score
- **Gewichtung:**  
Fundamental
- **Berechnungsbeginn:**  
30. Juni 2010

# TVG Sustainable USA Index

## BRANCHENGEWICHTUNG

BRANCHE	GEWICHTUNG
TECHNOLOGIE	22,2%
VERSICHERUNG	12,7%
INDUSTRIE	10,5%
EINZELHANDEL	9,8%
HAUSHALTSGÜTER	8,0%
GESUNDHEIT	6,7%
BANKEN	6,6%
IMMOBILIEN	5,7%
SONSTIGE	17,8%

## LÄNDERGEWICHTUNG

LAND	GEWICHTUNG
USA	93,3%
IRLAND	3,9%
SCHWEIZ	2,1%
BERMUDA	0,6%

## TOP HOLDINGS

UNTERNEHMEN	GEWICHTUNG
CISCO SYSTEMS INCO.	3,27%
ORACLE CORP.	3,19%
PRUDENTIAL FINL.INCO.	3,04%
METLIFE INCO.	2,76%
ACCENTURE PLC.	2,58%
QUALCOMM INCO.	2,18%
TJX COMPANIES INCO.	2,15%
US BANCORP	2,07%
CHUBB LTD.	1,81%
NIKE INCO.	1,76%

## 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)