

ESG Leading Companies Index

Das Ziel des ESG Leading Companies Index ist es, unter Berücksichtigung ethischer und nachhaltiger Anlagekriterien eine langfristige Outperformance zu erzielen. Hierzu werden zuerst aus den Mitgliedern des MSCI World Index Unternehmen herausgefiltert, die entweder in nicht-nachhaltigen Sektoren tätig sind, oder die durch unethische Verhaltensweisen aufgefallen sind. Aus den verbleibenden Unternehmen werden die 250 besten nach ESG Score gewählt. Aus diesen wiederum werden aus jedem der 19 ICB-Sektoren die fünf wettbewerbsfähigsten nach dem TVG Quality Score in den Index aufgenommen. Eine Gewichtung der Mitglieder nach Fundamentalfaktoren sorgt darüber hinaus für ein optimiertes Risiko-Rendite-Profil.

10-JAHRES RENDITE



KENNZAHLEN

	LEADING COMPANIES	MSCI WORLD
ALPHA	2,39%	
BETA	1,11	1
ANNUAL RETURN	13,32%	9,76%
STD. DEVIATION	13,09%	10,70%
TRACKING ERROR	5,63%	
SHARPE RATIO	1,00	0,89
TREYNOR RATIO	11,81%	9,56%
INFORM. RATIO	61,96%	

RENDITE

	LEADING COMPANIES	MSCI WORLD
1 JAHR	32,6%	26,5%
3 JAHRE	55,4%	42,3%
SEIT AUFLAGE	58,0%	40,6%

INDEXPROFIL

- **Benchmark:**
MSCI World
- **Asset Klasse:**
Aktien
- **Region:**
Welt
- **Anzahl Mitglieder:**
95
- **Währung:**
US Dollar
- **Umschichtungsdatum:**
30. September
- **Screening:**
Ethisch / Nachhaltig
- **Selektion:**
ESG Score, Quality Score
- **Gewichtung:**
Fundamental
- **Berechnungsbeginn:**
31. Juli 2014

ESG Leading Companies Index

BRANCHENGEWICHTUNG

BRANCHE	GEWICHTUNG
VERSICHERUNG	14,0%
BANKEN	11,1%
TELEKOM	7,9%
TECHNOLOGIE	7,0%
EINZELHANDEL	6,4%
INDUSTRIE	6,4%
AUTOMOBIL	6,0%
REISE & FREIZEIT	5,4%
SONSTIGE	35,9%

LÄNDERGEWICHTUNG

LAND	GEWICHTUNG
FRANKREICH	21,6%
USA	16,5%
DEUTSCHLAND	11,0%
VEREINIGTES KÖNIGREICH	8,5%
ITALIEN	5,8%
SCHWEIZ	5,3%
JAPAN	5,1%
NIEDERLANDE	4,6%
SONSTIGE	21,6%

TOP HOLDINGS

UNTERNEHMEN	GEWICHTUNG
BNP PARIBAS	4,38%
ALLIANZ	4,15%
AXA	3,82%
DEUTSCHE TELEKOM	3,19%
CISCO SYSTEMS	3,11%
ASSICURAZIONI GENERALI	2,94%
ACCENTURE CLASS A	2,91%
CARREFOUR	2,75%
TELEFONICA	2,55%
LLOYDS BANKING GROUP	2,51%

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

www.thevaluegroup.de