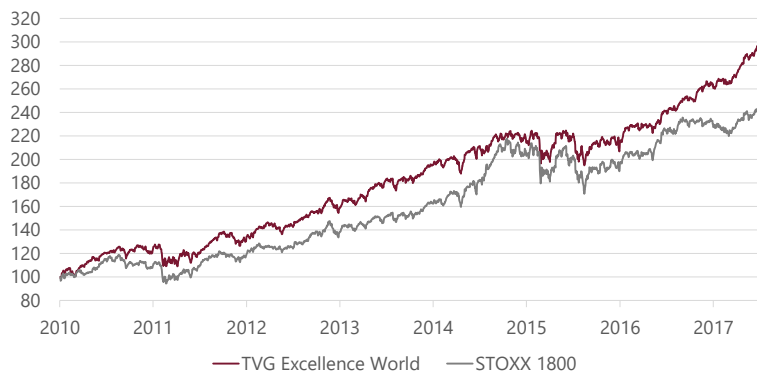


# TVG Excellence World Index

Der TVG Excellence World Index setzt sich aus den 150 besten Mitgliedern des STOXX 1800 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	STOXX 1800
ALPHA	5,58%	
BETA	0,77	1
ANNUAL RETURN	15,12%	11,84%
STD. DEVIATION	11,58%	12,67%
TRACKING ERROR	6,99%	
SHARPE RATIO	1,29	0,92
TREYNOR RATIO	19,50%	11,64%
INFORM. RATIO	39,47%	

## RENDITE

	TVG EXCELLENCE	STOXX 600
1 JAHR	26,0%	9,4%
3 JAHRE	72,4%	62,1%
5 JAHRE	104,5%	89,5%
SEIT AUFLAGE	205,1%	142,7%

## INDEXPROFIL

- **Benchmark:**  
STOXX 1800
- **Asset Klasse:**  
Aktien
- **Region:**  
Welt
- **Anzahl Mitglieder:**  
150
- **Währung:**  
Euro
- **Umschichtungsdatum:**  
30. Juni
- **Screening:**  
Nein
- **Selektion:**  
TVG Quality Score
- **Gewichtung:**  
Fundamental
- **Berechnungsbeginn:**  
30. Juni 2010

# TVG Excellence World Index

## BRANCHENGEWICHTUNG

BRANCHE	GEWICHTUNG
TECHNOLOGIE	29,6%
GESUNDHEIT	12,8%
HAUSHALTSGÜTER	11,3%
INDUSTRIE	8,2%
FINANZEN	7,3%
BANKEN	6,5%
TELEKOM	4,8%
EINZELHANDEL	3,5%
SONSTIGE	16,0%

## LÄNDERGEWICHTUNG

LAND	GEWICHTUNG
VEREINIGTE STAATEN	59,3%
JAPAN	11,3%
AUSTRALIEN	5,8%
SCHWEIZ	5,7%
DEUTSCHLAND	5,2%
VEREINIGTES KÖNIGREICH	4,4%
FRANKREICH	3,7%
NIEDERLANDE	1,6%
SONSTIGE	3,0%

## TOP HOLDINGS

UNTERNEHMEN	GEWICHTUNG
MICROSOFT CORP.	8,23%
JOHNSON & JOHNSON	5,51%
FACEBOOK INCO.	5,22%
ALPHABET INCO.	4,01%
ROCHE HOLDING	2,98%
HSBC	2,87%
VERIZON COMMUNICATIONS	2,82%
VISA INCO.	2,68%
TOYOTA MOTOR CORP.	2,65%
THE WALT DISNEY CO.	2,60%
MICROSOFT CORP.	8,23%

## 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)