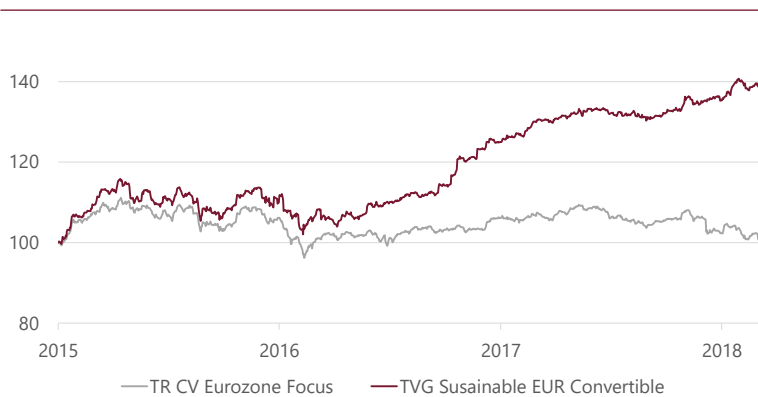


# TVG Sustainable EUR Convertibles Index

Das Ziel des TVG Sustainable EUR Convertibles Index ist es, unter Berücksichtigung ethischer und nachhaltiger Anlagekriterien eine langfristige Outperformance zu erzielen. Hierzu werden zuerst aus allen liquiden, in Euro notierten Wandelanleihen solche Emittenten herausgefiltert, die entweder in nicht-nachhaltigen Sektoren tätig, oder die durch unethische Verhaltensweisen aufgefallen sind. Aus den verbleibenden Unternehmen werden die Wandelanleihen der 60 nachhaltigsten Emittenten nach dem ESG Score in den Index aufgenommen.

## RENDITE



## KENNZAHLEN

	TVG SUSTAINABLE	TR CV EUROZONE
ALPHA	9,61%	-
BETA	0,68	1
ANNUAL RETURN	10,35%	0,48%
STD. DEVIATION	7,50%	6,16%
TRACKING ERROR	6,51%	-
SHARPE RATIO	1,35	0,05
TREYNOR RATIO	14,87%	0,28%
INFORM. RATIO	145,56%	-

## RENDITE

	TVG SUSTAINABLE	TR CV EUROZONE
1 JAHR	6,41%	13,42%
3 JAHRE	22,83%	18,87%
SEIT AUFLAGE	39,01%	1,62%

## INDEXPROFIL

- **Benchmark:**  
TR CV Eurozone Focus
- **Asset Klasse:**  
Wandelanleihen
- **Region:**  
Weltweit
- **Anzahl Mitglieder:**  
77
- **Währung:**  
Euro
- **Umschichtungsdatum:**  
30. Juni
- **Screening:**  
Nachhaltigkeit
- **Selektion:**  
ESG Score
- **Gewichtung:**  
Marktwert
- **Berechnungsbeginn:**  
01. Januar 2015

# TVG Sustainable EUR Convertibles Index

## BRANCHENGEWICHTUNG

BRANCHE	GEWICHTUNG
IMMOBILIEN	14,8%
TELEKOM	14,0%
FINANZDIENSTLEISTER	12,8%
REISE & FREIZEIT	11,,2%
INDUSTRIE	9,0%
BAU	6,4%
TECHNOLOGIE	4,1%
EINZELHANDEL	3,6%
SONSTIGE	14,8%

## LÄNDERGEWICHTUNG

LAND	GEWICHTUNG
CHINA	18,2%
FRANKREICH	10,7%
USA	10,6%
MEXIKO	10,6%
VEREINIGTES KÖNIGREICH	9,0%
JAPAN	8,1%
SPANIEN	6,2%
SINGAPUR	4,6%
SONSTIGE	22,1%

## TOP HOLDINGS

UNTERNEHMEN	GEWICHTUNG
AMERICA MOVIL SAB	10,6%
BNP PARIBAS	8,8%
BANK OF NY.MELLON	8,4%
CHINA EVERGRANDE GROUP	6,0%
CTRIIP.COM INTL.LTD.	4,9%
CAPITALAND LTD.	4,6%
AGEAS	3,5%
ANA HOLDINGS INCO.	3,5%
ACS ACTIV.CONSTR.Y SERV.	3,2%
INTL.CON.S.AIRL.GROUP SA	2,8%

## 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)