

# BNP PARIBAS EQUITY JAPAN CLIMATE CARE NTR INDEX



## MERKBLATT (FACTSHEET) | FEBRUAR 2024

Der Index ist an die Performance japanischer Aktien mit hohen ESG-Standards (Environmental, Social and Governance) gebunden und sorgfältig nach ihrem CO<sub>2</sub>-Fußabdruck [Scope 1 & Scope 2 Emissionen]<sup>1</sup> und der Stringenz ihrer Energiewende-Strategie ausgewählt

**“ Die Covid-19-Pandemie kann politischen und finanziellen Entscheidungsträgern eine „historische Gelegenheit“ bieten, globale Klimaschutzmaßnahmen voranzutreiben.**

*Fatih Birol, Leiter der Internationalen Energieagentur, 18. März 2020 (Übersetzt)*

## ECKPUNKTE: EIN NEUER ANSATZ FÜR DIE ENERGIEWENDE

- Einführung des Konzepts der Energiewende-Strategie: Da ein geringer CO<sub>2</sub>-Fußabdruck heutzutage nicht mehr ausreicht, um den Klimawandel langfristig zu bekämpfen, werden Aktien von Unternehmen nicht nur aufgrund ihrer aktuellen CO<sub>2</sub>-Emissionen, sondern auch aufgrund der Stringenz ihrer Energiewende-Strategie ausgewählt
- Ziel ist eine Reduzierung des CO<sub>2</sub>-Fußabdrucks um mindestens 50% gegenüber dem Moody's ESG Solutions Japan Universe<sup>2</sup>
- Der erwartete Tracking Error im Vergleich zu dem Moody's ESG Solutions Japan Universe darf 5% pro Jahr nicht überschreiten

### Investmentuniversum: Moody's ESG Solutions Japan Universe

- **Ausschluss von Aktien** mit einem Moody's ESG Solutions ESG-Score im untersten Quartil des jeweiligen Sektors oder unter 30/100 (absolut), oder die an Rüstungs-, Nuklear-, Tabak-, Pornografiengeschäften oder kritischen Kontroversen beteiligt sind
- Unter den Emittenten mit hohen CO<sub>2</sub>-Emissionen [bewertet durch Moody's ESG Solutions; mehr als 10 Mt CO<sub>2</sub>-Äquivalent] können von der Strategie nur diejenigen ausgewählt werden, die nach der Bewertung von Moody's ESG Solutions den besten Energiewende-Score in ihrem Sektor haben
- **Liquidität:** Das durchschnittliche tägliche Handelsvolumen einer Aktie muss über 1 und 6 Monate über 1 Milliarden japanische Yen liegen
- **Gewichtung:** Die Gewichtung jeder einzelnen Aktie muss zwischen 0% und 5% liegen (Neugewichtung erfolgt einmal im Quartal) und ist zudem abhängig von ihrer Liquidität
- **Sektor Diversifikation:** Die Gewichtung jedes Sektors darf nicht mehr als 30% gegenüber der Gewichtung des selben Sektors im Moody's ESG Solutions Japan Universe abweichen

Die endgültige Auswahl des Portfolios muss folgende Kriterien erfüllen:



5% Jährlich

Der erwartete Tracking Error gegenüber dem Moody's ESG Solutions Japan Universe beträgt weniger als 5% pro Jahr



-50%

Es hat einen um mindestens 50% reduzierten CO<sub>2</sub>-Fußabdruck im Vergleich zum Moody's ESG Solutions Japan Universe



Max.

Es maximiert den Moody's ESG Solutions Energy Transition Score unter anderem unter den o.g. Bedingungen



<sup>1</sup>Scope 1 entspricht den direkten Emissionen, wie Energieverbrauch, unter Ausschluss von Elektrizität, Kraftstoffverbrennung, Emissionen aus Industrieverfahren und diffusen Emissionen. Scope 2 entspricht den indirekten Emissionen in Verbindung mit Energie, wie Stromverbrauch oder Verbrauch von Dampf, Wärme oder Kälte über Vertriebsnetze. Scope 3 umfasst sämtliche sonstigen indirekten Emissionen (Kauf von Rohstoffen, Verpackung, Produktion von Brennstoff, Anlagevermögen, usw.); Die Berechnung erfolgt durch Moody's ESG Solutions auf Basis der unter anderem zuvor beschriebenen Einflussfaktoren; Quelle: Moody's ESG Solutions 2015; Moody's ESG Solutions ist ein globaler Anbieter von ESG Forschung und Dienstleistungen von dem BNP Paribas Daten für die Optimierung des BNP PARIBAS EQUITY JAPAN CLIMATE CARE NTR INDEX bezieht. <sup>2</sup>Das „Moody's ESG Solutions Japan Universe“ besteht aus allen Aktien des ursprünglichen Universums von Moody's ESG Solutions mit der geografischen Eingrenzung auf Japan. Die Gewichtung jeder Aktie innerhalb des Moody's ESG Solutions Japan Universe ist proportional zur sich im Streubesitz befindenden Markt kapitalisierung.



## INDEXMERKMALE



Währung  
EUR

Ticker  
BNPIJPCC Index

Live Datum  
27. März 2020



Net Total  
Return

Barausschüttungen wie  
Dividenden werden in  
den Index reinvestiert



Quartalsweises  
Rebalancing

Ende März, Juni,  
September  
und Dezember

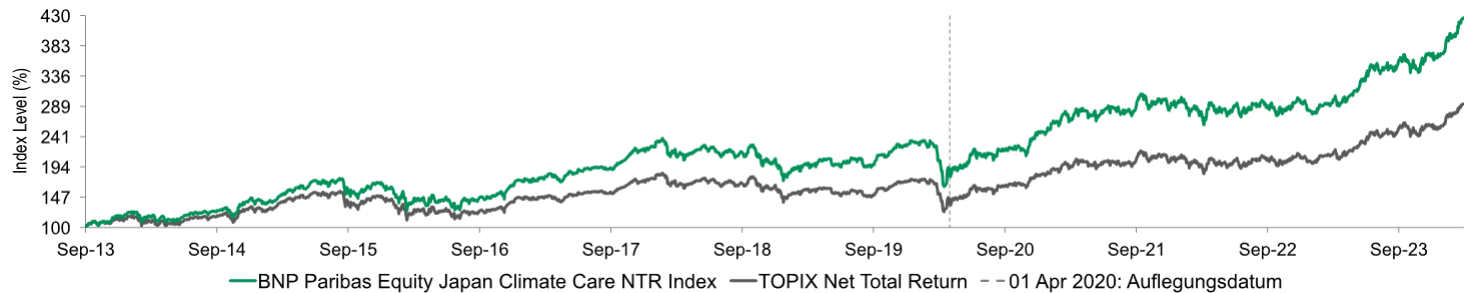
MOODY'S ESG Solutions

Langjährige  
Partnerschaft

Moody's ESG Solutions  
ist ein globaler Anbieter  
von ESG Forschung und  
Dienstleistungen

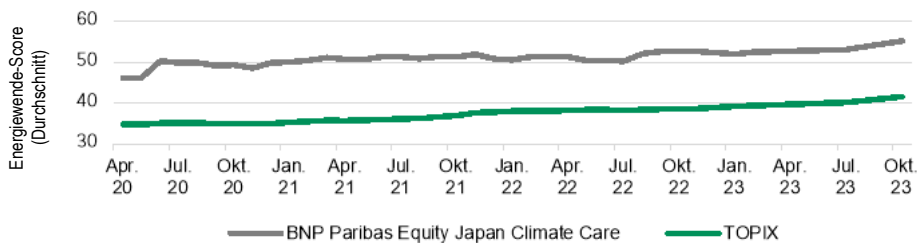
Stand 29 Februar 2024

## PERFORMANCE



Sep 13 - Feb 24	Japan Climate Care	TOPIX Net Total Return
Performance auf Jahresbasis	14,78%	10,75%
Annualisierte Volatilität	18,87%	17,85%
Sharpe Ratio	0,78	0,60
Korrelation	0,98	-
Max. Rückgang	-31,51%	-32,66%
Energy Transition Score	55,65	33,20

Quellen: Bloomberg, BNP Paribas. Vergleichsindex: TOPIX Net Total Return Index, Bloomberg Code: <TPXNTR Index>. Die Indizes wurden am 02. September 2013 auf 100% zurückgesetzt. Die simulierte oder historische Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung. Für die dynamische Simulation wurden vor November 2019 statische Daten von Moody's ESG Solutions verwendet.



<b>FORTGESCHRITTEN</b>	■ Zwischen 60 und 100 Punkte
<b>ROBUST</b>	■ Zwischen 50 und 59 Punkte
<b>BEGRENZT</b>	■ Zwischen 30 und 49 Punkte
<b>SCHWACH</b>	■ Zwischen 0 und 29 Punkte

Der durchschnittliche Energiewende-Score für den BNP Paribas Equity Japan Climate Care Index liegt deutlich über dem Energiewende-Score für den TOPIX. Die Daten werden monatlich zur Verfügung gestellt. Quelle: BNP Paribas, Moody's ESG Solutions.

## TOP 10 EINZELWERTE

Namen	Bloomberg-Code	Währung	Land	Branche	Gewichtung
TOKYO ELECTRON	8035 JT Equity	JPY	Japan	Technologie	5,38%
DENSO	6902 JT Equity	JPY	Japan	Zyklische Konsumgüter	5,08%
ADVANTEST	6857 JT Equity	JPY	Japan	Technologie	4,99%
NIPPON TELG. & TEL.	9432 JT Equity	JPY	Japan	Telekommunikation	4,89%
DAIICHI SANKYO	4568 JT Equity	JPY	Japan	Gesundheit	4,62%
RECRUIT HOLDINGS	6098 JT Equity	JPY	Japan	Industrie	4,57%
FANUC	6954 JT Equity	JPY	Japan	Industrie	4,38%
FUJITSU	6702 JT Equity	JPY	Japan	Technologie	3,24%
MITSUBISHI ESTATE	8802 JT Equity	JPY	Japan	Finanzwesen	2,71%
DAI-ICHI LIFE HOLDINGS	8750 JT Equity	JPY	Japan	Finanzwesen	2,65%

Quelle: BNP Paribas.

Es gilt zu beachten, dass die Obergrenze von 5% nur gewährleistet werden muss, wenn das Aktienportfolio neu gewichtet wird. Aktien können an Wert gewinnen, und einen höheren Anteil im Portfolio einnehmen.



Learn more  
ABOUT GLOBAL MARKETS

<https://globalmarkets.cib.bnpparibas/>



### DISCLAIMER

Wichtige rechtliche Hinweise – bitte lesen.

Dieses Merkblatt (Factsheet) wurde von der BNP Paribas S.A., Niederlassung Deutschland erstellt. Die in diesem Factsheet enthaltenen Informationen stellen keine Anlageberatung bzw. Anlageempfehlung dar, weil sie die persönlichen Verhältnisse eines Anlegers nicht berücksichtigen, d. h. sie sind nicht auf die Bedürfnisse einer natürlichen oder juristischen Person bzw. Kundengruppe zugeschnitten und dienen nur zu Informationszwecken. Es stellt weder ein Angebot noch eine Beratung, Empfehlung oder Aufforderung zum Kauf, Verkauf oder Halten irgendeiner Finanzanlage mit Bezug zu dem in diesem Factsheet dargestellten Index dar. Ferner handelt es sich nicht um eine Aufforderung, ein solches Angebot zu stellen.

Die in diesem Factsheet enthaltenen Informationen wurden von uns sorgfältig zusammengestellt und beruhen auf Quellen, die wir für zuverlässig erachten. Eine Gewähr für die Vollständigkeit und Richtigkeit können wir jedoch nicht übernehmen. Es handelt sich um Informationen, die weder den gesetzlichen Anforderungen zur Gewährleistung der Unvoreingenommenheit bzw. der Förderung der Unabhängigkeit von Finanzanalysen noch dem Verbot des Handels im Anschluss an die Verbreitung von Finanzanalysen unterliegen. BNP Paribas S.A. rät dringend, vor jeder Anlageentscheidung eine persönliche Beratung in Anspruch zu nehmen. BNP Paribas S.A. (samt Zweigniederlassungen) ist kein Steuerberater und prüft nicht, ob eine Anlageentscheidung für den Kunden steuerlich günstig ist. Die steuerliche Behandlung hängt von den persönlichen Verhältnissen des Kunden ab und kann künftig Änderungen unterworfen sein.

Das vorliegende Dokument wurde von der BNP Paribas S.A. Niederlassung Deutschland erstellt, eine Niederlassung der BNP Paribas S.A. mit Hauptsitz in Paris, Frankreich. BNP Paribas S.A. Niederlassung Deutschland, Europa-Allee 12, 60327 Frankfurt am Main wird von der Europäischen Zentralbank (EZB) und der Autorité de Contrôle Prudentiel et de Résolution (ACPR) beaufsichtigt, ist von der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin) zugelassen und ist Gegenstand beschränkter Regulierung durch die BaFin. BNP Paribas S.A. ist von der EZB und der ACPR zugelassen und wird von der Autorité des Marchés Financiers in Frankreich beaufsichtigt. BNP Paribas S.A. ist als Gesellschaft mit beschränkter Haftung in Frankreich eingetragen. Sitz: 16 Boulevard des Italiens, 75009 Paris, France.

Der TOPIX-Indexwert und die TOPIX-Marken unterliegen den Eigentumsrechten der Tokyo Stock Exchange, Inc. Des Weiteren besitzt die Tokyo Stock Exchange, Inc. alle Rechte und das Know-how in Bezug auf den TOPIX, bezogen auf die Berechnung, Veröffentlichung und Nutzung des TOPIX Indexwerts und die TOPIX Marken. Kein Produkt wird in irgendeiner Weise von der Tokyo Stock Exchange, Inc. gesponsert, empfohlen oder beworben.

© 2021 BNP Paribas. Alle Rechte vorbehalten. Wiedergabe oder Vervielfältigung des Inhalts dieses Factsheets oder von Teilen davon in jeglicher Form ohne unsere vorherige Einwilligung sind untersagt. [www.bnpparibas.com](http://www.bnpparibas.com).

