

BNP PARIBAS EQUITY US CLIMATE CARE NTR INDEX



MERKBLATT (FACTSHEET) | FEBRUAR 2024

Der Index ist an die Performance amerikanischer Aktien mit hohen ESG-Standards (Environmental, Social and Governance) gebunden und sorgfältig nach ihrem CO₂-Fußabdruck [Scope 1 & Scope 2 Emissionen]¹ 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 CO₂-Fußabdruck heutzutage nicht mehr ausreicht, um den Klimawandel langfristig zu bekämpfen, werden Aktien von Unternehmen nicht nur aufgrund ihrer aktuellen CO₂-Emissionen, sondern auch aufgrund der Stringenz ihrer Energiewende-Strategie ausgewählt
- Ziel ist eine Reduzierung des CO₂-Fußabdrucks um mindestens 50% gegenüber dem Moody's ESG Solutions US Universe²
- Der erwartete Tracking Error im Vergleich zu dem Moody's ESG Solutions US Universe darf 5% pro Jahr nicht überschreiten

Investmentuniversum: Moody's ESG Solutions US 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-, Pornografiegeschäften oder kritischen Kontroversen beteiligt sind
- Unter den Emittenten mit hohen CO₂-Emissionen [bewertet durch Moody's ESG Solutions; mehr als 10 Mt CO₂-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 10 Millionen U.S. Dollar liegen
- **Gewichtung:** Die Gewichtung jeder einzelnen Aktie muss zwischen 0% und 2% 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 US Universe abweichen

Die endgültige Auswahl des Portfolios muss folgende Kriterien erfüllen:



5% Jährlich

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



-50%

Es hat einen um mindestens 50% reduzierten CO₂-Fußabdruck im Vergleich zum Moody's ESG Solutions US Universe



Max.

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



¹Scope 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 US CLIMATE CARE NTR INDEX bezieht. ²Das „Moody's ESG Solutions US Universe“ besteht aus allen Aktien des ursprünglichen Universums von Moody's ESG Solutions mit der geografischen Eingrenzung auf die USA. Die Gewichtung jeder Aktie innerhalb des Moody's ESG Solutions US Universe ist proportional zur sich im Streubesitz befindenden Marktkapitalisierung.



INDEXMERKMALE



Währung
EUR

Ticker
BNPIUSCC Index

Live Datum
27. März 2020



Net Total
Return

Barausschüttungen wie
Dividenden werden in
den Index reinvestiert



Quartalsweises
Rebalancing

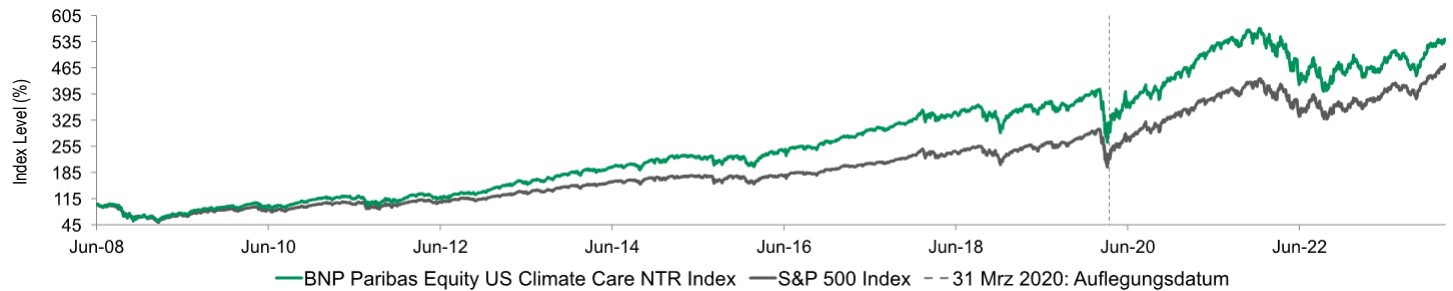
Ende März, Juni,
September
und Dezember

MOODY'S ESG Solutions

Langjährige
Partnerschaft

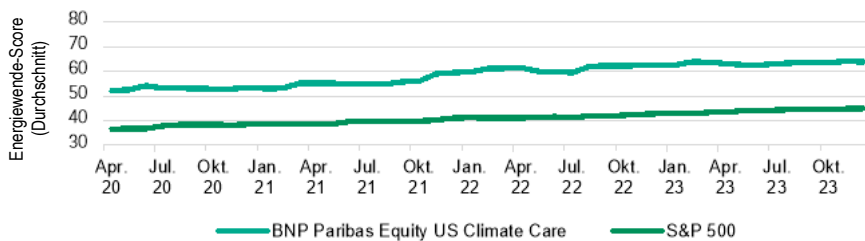
Moody's ESG Solutions
ist ein globaler Anbieter
von ESG Forschung und
Dienstleistungen

PERFORMANCE



Jun 08 - Feb 24	US Climate Care	S&P 500 Index
Performance auf Jahresbasis	11,35%	10,42%
Annualisierte Volatilität	21,57%	20,44%
Sharpe Ratio	0,53	0,51
Korrelation	0,98	-
Max. Rückgang	-46,81%	-48,91%
Energy Transition Score	63,21	39,22

Quellen: Bloomberg, BNP Paribas zum 31 Januar 2024. Vergleichsindex: S&P 500 Net Total Return Index, Bloomberg Code: <SPTR500N Index>. Die Indizes wurden am 18. Juni 2008 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.



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

Der durchschnittliche Energywende-Score für den BNP Paribas Equity US Climate Care Index liegt deutlich über dem Energywende-Score für den S&P 500. Die Daten werden monatlich zur Verfügung gestellt. Quelle: BNP Paribas, Moody's ESG Solutions zum 31 Januar 2024.

TOP 10 EINZELWERTE

Namen	Bloomberg-Code	Land	Branche	Währung	Gewichtung
DELL TECHNOLOGIES C	DELL UN Equity	United States	Technologie	USD	2,19%
FIDELITY NAT.INFO.SVS.	FIS UN Equity	United States	Technologie	USD	2,17%
NVIDIA	NVDA UW Equity	United States	Technologie	USD	2,15%
SALESFORCE	CRM UN Equity	United States	Technologie	USD	2,11%
HOST HOTELS & RESORTS REIT	HST UW Equity	United States	Finanzwesen	USD	2,08%
HOME DEPOT	HD UN Equity	United States	Zyklische Konsumgüter	USD	2,07%
NEWS 'A'	NWSA UW Equity	United States	Zyklische Konsumgüter	USD	2,05%
AMERICAN EXPRESS	AXP UN Equity	United States	Finanzwesen	USD	2,05%
AGILENT TECHS.	A UN Equity	United States	Gesundheit	USD	2,04%
COLGATE-PALM.	CL UN Equity	United States	Nichtzyklische Konsumgüter	USD	2,03%

Quelle: BNP Paribas zum 31 Januar 2024. Es gilt zu beachten, dass die Obergrenze von 2% 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 S&P500® ist ein Produkt von S&P Dow Jones Indices LLC („SPDJ“), und wurde zur Verwendung an BNP Paribas S.A. und an jede von BNP Paribas S.A. gehaltene Tochtergesellschaft lizenziert. Standards & Poor's® und S&P® sind eingetragene Handelsmarken von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“); Dow Jones® ist eine eingetragene Handelsmarke von Dow Jones Trademark Holdings LLC („Dow Jones“); und diese Handelsmarke wurde an SPDJI zur Nutzung und für bestimmte Zwecke zur Unterlizenzierung lizenziert. Die Wertpapiere des Lizenznehmers werden von SPDJI, Dow Jones, S&P, und ihren jeweiligen verbundenen Unternehmen weder gesponsert, unterstützt, verkauft oder vertrieben und keine dieser Parteien nimmt Stellung dazu, ob eine Anlage in die Wertpapiere anzuraten ist. Der Lizenzgeber übernimmt keine Haftung für Fehler in den Berechnungen, Auslassungen oder Unterbrechungen in der Berechnung des S&P500

© 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.

