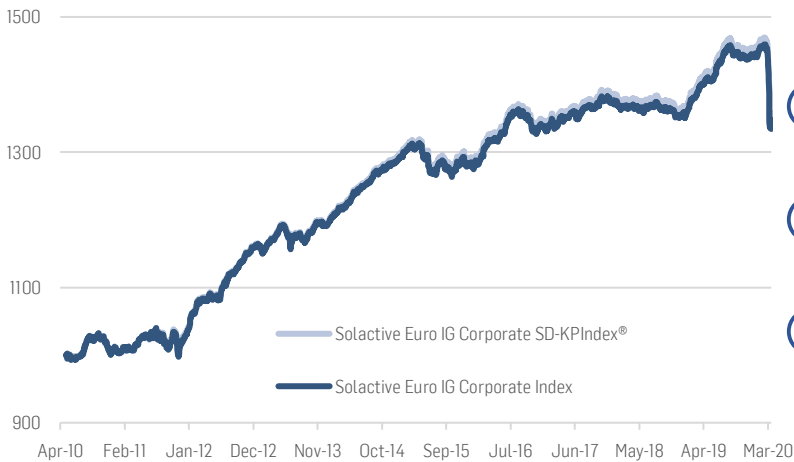


# Solactive Euro IG Corporate SD-KPIndex®



## Warum Solactive Indizes?

- ✓ **Effizienz:** Einfacher Zugang zu EUR Investment Grade Anleihen mit einem ESG Overlay
- ✓ **Flexibilität:** Der Index kann basierend auf den kundenspezifischen Wünschen maßgeschneidert werden
- ✓ **Qualität:** Solactive wurde als "Best Index Provider of the Year" und "Most Innovative ETF Index Provider in Europe" für das Jahr 2017<sup>1</sup> ausgezeichnet

Der **Solactive Euro IG Corporate SD-KPIndex®** ist ein diversifizierter, regelbasierter Index auf in Euro notierte Investment Grade Anleihen mit einer besonderen Gewichtung gemäß der SD-KPIndex® Methodologie.

## Selektionsuniversum

Der Solactive Euro IG Corporate KPIndex® umfasst die gleichen Indexmitglieder wie der Solactive Euro IG Corporate Index (die Benchmark).

Dieser umfasst Investment Grade Anleihen, welche in Euro (EUR) notiert sind.

Die folgenden Filter werden angewandt:

- Ausstehendes Volumen: mind. 500 Mio. EUR
- Effektive Restlaufzeit: mind. ein Jahr bis zur Fälligkeit an jedem Anpassungstag
- Rating: Ein Mindest-Rating von BBB- von Standard & Poor's oder Baa3 von Moody's Investors Service wird benötigt. Falls eine der Ratingagenturen eine Anleihe als Investment Grade einstuft, kann diese in den Index aufgenommen werden
- Zugelassene Anleihtypen: Anleihen mit fixem Kupon, Nullkuponanleihen, Payment-in-Kind Anleihen, Step-Up-Kupon Anleihen, Bearer Bonds and Callable Perpetual Anleihen können in den Index aufgenommen werden
- Ausgeschlossene Anleihtypen: Variabel verzinsliche Anleihen, Pfandbriefe, Inflationsgeschützte Anleihen, Sinking Fund Bonds, Convertible Bonds, Contingent Capital Securities, Preferred securities, Collateralized Debt Obligations (CDOs), Anleihen von supranationalen Organisationen sowie Privatplatzierungen werden nicht in den Index aufgenommen



## Gewichtungsverfahren

Die Indexmitglieder des Benchmark Index werden basierend auf ihrem anteiligen Marktwert am Gesamtmarktwert des Index gewichtet. Diese Gewichtung stellt die Basis für die Gewichtung der Anleihen im Solactive Euro IG Corporate SD-KPIndex® dar.

Gemäß der SD-KPIndex® Methodologie werden die Ausgangsgewichte der Benchmark wie folgt angepasst:

An jedem Selektionstag werden die Mitglieder des Benchmark Index in Quintile unterteilt basierend auf den zugehörigen SD-KPIntegration® Scores. Die besten 20% Prozent werden 50% übergewichtet, die zweiten 20% um 25%, das mittlere Quintil wird weder unter- noch übergewichtet und die beiden unteren Quintile werden um 25% bzw. 50% untergewichtet.

Damit werden Anleihen von Unternehmen übergewichtet, welche besonders hohe SD-KPIntegration® Scores aufweisen.

„Sustainable Development Key Performance Indicators“ (SD-KPIs) sind drei industrie-spezifisch besonders materielle ESG-Indikatoren, welche in SD-KPI Standards mit Unterstützung des dt. Bundesumweltministeriums und des Sustainability Accounting Standard Boards (SASB) von der SD-M® GmbH definiert wurden.

Da kein Ausschluss von Anleihen erfolgt, bleibt der Index breit diversifiziert.

Auf Kundenwunsch können Anleihenemittenten in Customized Indexvarianten ausgeschlossen sowie andere Indexkriterien angepasst werden.

<sup>1</sup> 15th Europe Structured Products & Derivatives Conference 2018. Available at: [https://www.structuredretailproducts.com/uploads/general\\_files/SR/SRP's\\_15th\\_Europe\\_Structured\\_Products\\_&\\_Derivatives\\_Awards\\_Winners\\_2018\\_1.pdf](https://www.structuredretailproducts.com/uploads/general_files/SR/SRP's_15th_Europe_Structured_Products_&_Derivatives_Awards_Winners_2018_1.pdf)

<sup>14th</sup> Annual Global ETF Awards. Available at: <http://www.globaletfawards.com/>

# Solactive Euro IG Corporate SD-KPIndex®

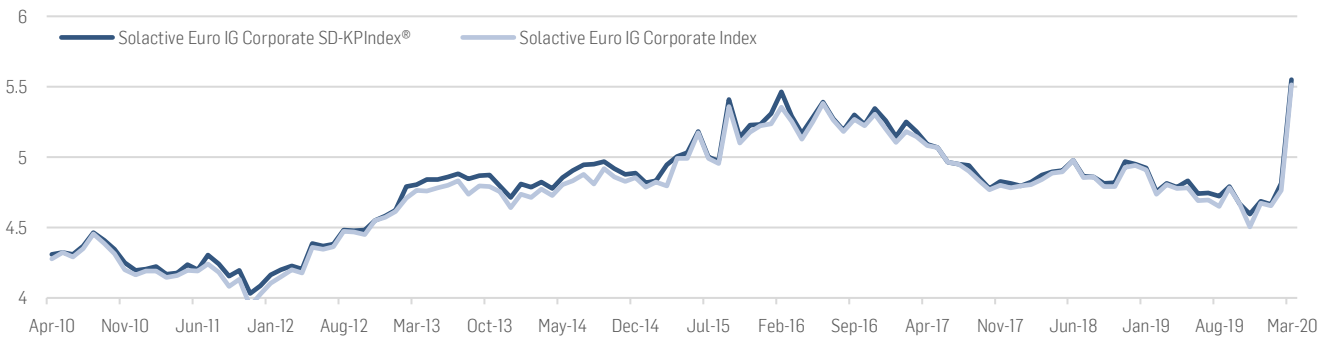
## ✂ Index Charakteristika

Währung	Kategorie	Region	Indexart	Reinvestment	Preisdefinition	Preisanbieter	Start der Rückrechnung
EUR	Corporates	Global	Total Return	monatlich	Bid-Ask	ICE	01.04.2010

## 📊 Index Performance

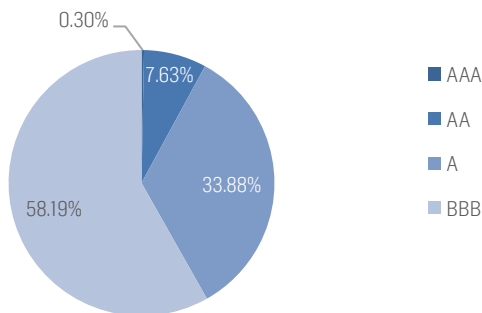
	Solactive Euro IG Corporate SD-KPIndex®	Solactive Euro IG Coporate Index
Annualisierte Performance (seit Start der Rückrechnung)	3.06%	2.99%
Annualisierte Standardabweichung (seit Start der Rückrechnung)	2.44%	2.43%
Tracking Error (seit Start der Rückrechnung)	0.10%	0.00%
Annualisierte Performance (1 Jahr)	-2.82%	-2.79%
Annualisierte Standardabweichung (1 Jahr)	3.77%	3.74%
Tracking Error (1 Jahr)	0.04%	0.00%
Annualisierte Performance (3 Jahre)	0.29%	0.23%
Annualisierte Standardabweichung (3 Jahre)	2.60%	2.59%
Tracking Error (3 Jahre)	0.04%	0.00%

## 🌐 Historische durchschnittliche Duration

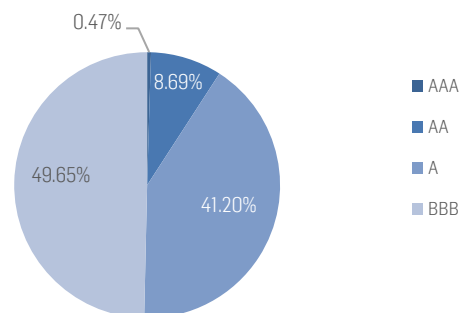


## ⚙ Ratingaufteilung

Solactive Euro IG Corporate SD-KPIndex®



Solactive Euro IG Coporate Index



## Disclaimer

All numbers on this document are updated as of Q1 2020.

The information in this document does not constitute tax, legal or investment advice and is not intended as a recommendation for buying or selling securities. Solactive AG and all other companies mentioned in this document are not responsible for the consequences of reliance upon any opinion or statement contained herein or for any omission.

© Solactive AG, 2020. All rights reserved.