

Solactive mit neuem Euro IG Corporate Index mit ESG-Integration

21.11.2019 | [AM Reports](#) | Erstellt von Frank Schnattinger

SD-M liefert Sustainability-Daten

ESG gilt als eines der Hauptthemen des Jahres 2019. Während sich Asset Manager und Investoren zunehmend auf dieses spannende und zukunftsweisende Gebiet fokussieren, gibt es viele Wege, ESG-Kriterien zu implementieren.

Der deutsche ESG-Provider SD-M mit Gründer Dr. Axel Hesse an der Spitze machte es sich deswegen zur Aufgabe, ein robustes und übersichtliches ESG-Klassifikationsmodell zu entwickeln, das sich auf drei standardisierte und wesentliche ESG-Kennzahlen für die jeweiligen betrachteten Sektoren stützt.



Dr. Axel Hesse

Solactive nutzt nun den Ansatz von SD-M, um den Solactive Euro IG Corporate SD-KPIIndex zu veröffentlichen, der sich insbesondere an Investoren richtet, die eine zuverlässige und leicht zugängliche ESG-Benchmark im Bereich der Investment-Grade-Corporates benötigen.

Der Solactive Euro IG Corporate SD-KPIIndex baut auf dem branchenweit verwendeten Solactive Euro IG Corporate Index auf, der die Performance von Investment-Grade-Anleihen in EUR abbildet.

Die SD-KPIIndex-Variante nutzt das market-cap gewichtete Anlageuniversum des Dach-Index, gewichtet aber darüber hinaus seine Bestandteile gemäß der SD-KPIIndex Methodik: Am Auswahltag werden die Indexbestandteile auf Basis des SD-KPIIntegration Scoring in verschiedene Quintile aufgeteilt.

Das Verfahren weist den Top-20-Prozent des Anlageuniversums eine Übergewichtung von 50% zu. Die restlichen Quintile erhalten gemäß ihres ESG-Scorings jeweils Quintil für Quintil 25% weniger Gewichtung, sodass die zweiten zwanzig Prozent eine Übergewichtung von 25% erzielen, das mittlere Quintil unverändert bleibt und die beiden unteren Quintile eine Untergewichtung von 25% bzw. 50% erhalten.

Der von SD-M entwickelte SD-KPI Standard 2016-2021 besteht dabei aus drei branchenspezifischen ESG-Indikatoren, die auf umfangreichen Analysen basieren und mit Unterstützung des Bundesumweltministeriums, Investoren und Analysten sowie des Sustainability Accounting Standards Board (SASB) entwickelt wurden.

Ferner umfasst die Zusammenarbeit von Solactive mit SD-M zwei weitere Fixed Income Indices, darunter den Solactive USD IG Corporate SD-KPIndex für den Bereich der USD-Unternehmensanleihen sowie den Solactive GBP IG Corporate SD-KPIndex für auf GBP basierende, indexierbare Unternehmensanleihen.

Timo Pfeiffer, Chief Markets Officer bei Solactive, kommentierte: „Am Kapitalmarkt macht sich Schritt für Schritt die wachsende Bedeutung von ESG-Integration in Investor-Portfolios bemerkbar. Aus diesem Grund sind wir sehr stolz darauf, einen neuen Bond-Index anbieten zu können, der ESG-Kennzahlen angemessen in den europäischen Markt für Unternehmensanleihen integriert. Dabei bietet der Index trotz seiner Priorisierung von Unternehmen, die ESG in ihre Geschäftspraktiken integrieren, ein breites Exposure zum Markt.“

„SD-M freut sich sehr, dass Investoren mit dem Solactive Investment Grade Corporate SD-KPIndex nun auch die wichtige Assetklasse der Unternehmensanleihen adressieren können“, so Dr. Axel Hesse, Gründer und Gesellschafter der SD-M. „Darüber hinaus bietet die Outperformance von 8 Basispunkten p.a. im Backtest der Euro-Variante seit 2010 einen interessanten Zusatznutzen gegenüber der Benchmark.“

Link: [Solactive Euro IG Corporate SD-KPIndex](#)