

BNP PARIBAS EQUITY EUROZONE CLIMATE CARE NTR INDEX



MERKBLATT (FACTSHEET) | FEBRUAR 2024

Der Index ist an die Performance europäischer 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 Eurozone Universe²
- Der erwartete Tracking Error im Vergleich zu dem Moody's ESG Solutions Eurozone Universe darf 5% pro Jahr nicht überschreiten

Investmentuniversum: Moody's ESG Solutions Eurozone 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 Euro 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 Eurozone Universe abweichen

Die endgültige Auswahl des Portfolios muss folgende Kriterien erfüllen:



5% Jährlich

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



-50%

Es hat einen um mindestens 50% reduzierten CO₂-Fußabdruck im Vergleich zum Moody's ESG Solutions Eurozone 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 EUROZONE CLIMATE CARE NTR INDEX bezieht. ²Das „Moody's ESG Solutions Eurozone Universe“ besteht aus allen Aktien des ursprünglichen Universums von Moody's ESG Solutions mit der geografischen Eingrenzung auf die Eurozone. Die Gewichtung jeder Aktie innerhalb des Moody's ESG Solutions Eurozone Universe ist proportional zur sich im Streubesitz befindenden Marktkapitalisierung.



INDEXMERKMALE



Währung
EUR

Ticker
BNPIEZCC 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

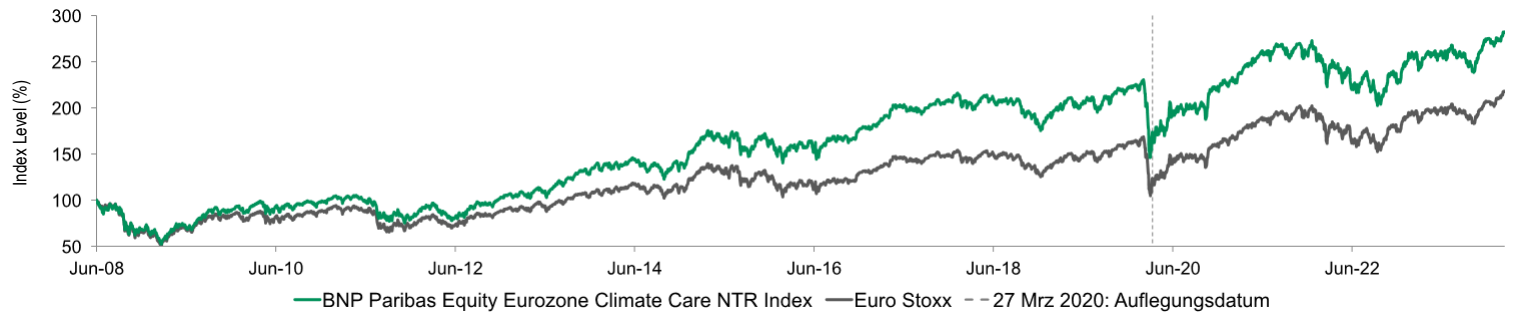
MOODY'S ESG Solutions

Langjährige Partnerschaft

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

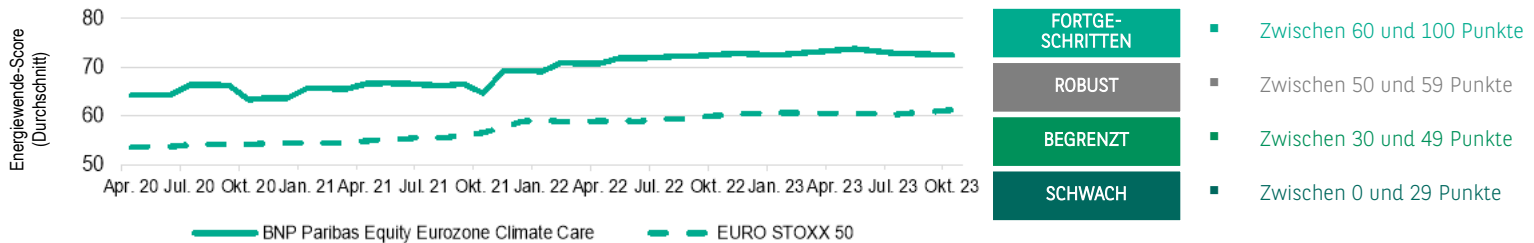
PERFORMANCE

Stand 29 Februar 2024



Jun 08 - Feb 24	Eurozone Climate Care	Euro Stoxx
Performance auf Jahresbasis	6,81%	5,07%
Annualisierte Volatilität	20,17%	21,08%
Sharpe Ratio	0,34	0,24
Korrelation	0,98	-
Max. Rückgang	-47,53%	-49,37%
Energy Transition Score	70,34	55,26

Quellen: BNP Paribas. Vergleichsindex: EURO STOXX Net Total Return Index, Bloomberg Code: <SXXT 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.



Der durchschnittliche Energiewende-Score für den BNP Paribas Equity Eurozone Climate Care Index liegt deutlich über dem Energiewende-Score für den EURO STOXX. Die Daten werden monatlich zur Verfügung gestellt. Quelle: BNP Paribas, Moody's ESG Solutions, Stand 31 Oktober 2023.

TOP 10 EINZELWERTE

Stand 29 Februar 2024

Namen	Land	Branche	Bloomberg-Code	Währung	Gewichtung
SIEMENS	Germany	Industrie	SIE GY Equity	EUR	5,35%
SAP	Germany	Technologie	SAP GY Equity	EUR	5,10%
ALLIANZ	Germany	Finanzwesen	ALV GY Equity	EUR	5,05%
SCHNEIDER ELECTRIC	France	Industrie	SU FP Equity	EUR	4,63%
L'OREAL	France	Nichtzyklische Konsumgüter	OR FP Equity	EUR	4,34%
BNP PARIBAS	France	Finanzwesen	BNP FP Equity	EUR	4,22%
HERMES INTERNATIONAL	France	Zyklische Konsumgüter	RMS FP Equity	EUR	4,07%
BANCO SANTANDER	Spain	Finanzwesen	SAN SQ Equity	EUR	3,92%
KERING	France	Zyklische Konsumgüter	KER FP Equity	EUR	3,26%
AXA	France	Finanzwesen	CS FP Equity	EUR	3,23%

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 EURO STOXX Index ist das geistige Eigentum (einschließlich eingetragener Marken) von STOXX Limited, Zürich, Schweiz ("STOXX"), der Deutschen Börse Group oder deren Lizenzgebern. Dieses Factsheet wird von STOXX, der Deutschen Börse Group oder ihren Lizenzgebern, Forschungspartnern oder Datenanbietern weder gesponsert noch beworben, verbreitet oder auf andere Weise unterstützt, und STOXX, die Deutsche Börse Group und ihre Lizenzgeber, Forschungspartner oder Datenanbieter geben keine Gewährleistung. Ausschluss jeglicher Haftung (ob fahrlässig oder auf andere Weise) in Bezug auf Fehler, Auslassungen oder Unterbrechungen im EURO STOXX Index oder seinen Daten.

© 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.

