

BNP PARIBAS EQUITY EUROZONE CLIMATE CARE NTR INDEX



MERKBLATT (FACTSHEET) | OKTOBER 2021

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 Vigeo Eiris Eurozone Universe²
- Der erwartete Tracking Error im Vergleich zu dem Vigeo Eiris Eurozone Universe darf 5% pro Jahr nicht überschreiten

Investmentuniversum: Vigeo Eiris Eurozone Universe

- **Ausschluss von Aktien** mit einem Vigeo Eiris 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 CO₂-Emissionen [bewertet durch Vigeo Eiris; mehr als 10 Mt CO₂-Äquivalent] können von der Strategie nur diejenigen ausgewählt werden, die nach der Bewertung von Vigeo Eiris 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 Vigeo Eiris Eurozone Universe abweichen

Die endgültige Auswahl des Portfolios muss folgende Kriterien erfüllen:



5% Jährlich

Der erwartete Tracking Error gegenüber dem Vigeo Eiris Eurozone Universe beträgt weniger als 5% pro Jahr



-50%

Es hat einen um mindestens 50% reduzierten CO₂-Fußabdruck im Vergleich zum Vigeo Eiris Eurozone Universe

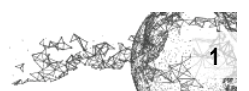
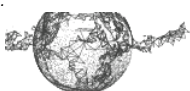


Max.

Es maximiert den Vigeo Eiris 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 Vigeo Eiris auf Basis der unter anderem zuvor beschriebenen Einflussfaktoren; Quelle: Vigeo Eiris 2015; Vigeo Eiris 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 „Vigeo Eiris Eurozone Universe“ besteht aus allen Aktien des ursprünglichen Universums von Vigeo Eiris mit der geografischen Eingrenzung auf die Eurozone. Die Gewichtung jeder Aktie innerhalb des Vigeo Eiris 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

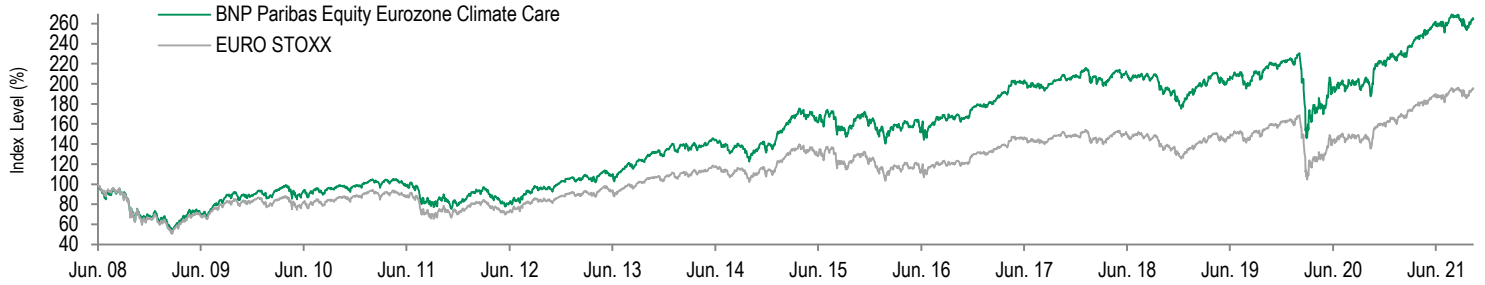
Ende März, Juni, September und Dezember



Langjährige Partnerschaft

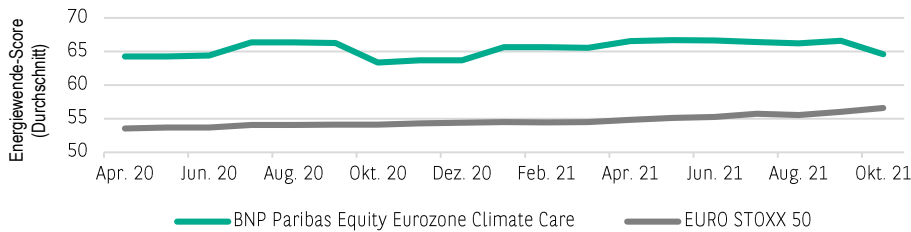
Vigeo Eiris ist ein globaler Anbieter von ESG Forschung und Dienstleistungen

PERFORMANCE



| Jun 08 - Okt 21 | BNP Paribas Equity Eurozone Climate Care | EURO STOXX |
|----------------------------------|--|------------|
| Annualisierte Performance | 7.54% | 5.14% |
| Annualisierte Volatilität | 20.64% | 21.61% |
| Sharpe Ratio | 0.37 | 0.24 |
| Korrelation | 0.98 | |
| Maximaler Drawdown | -47.53% | -49.37% |

Quellen: Bloomberg, BNP Paribas zum 31. Oktober 2021. 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 Vigeo Eiris 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 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, Vigeo Eiris, Stand 31. Oktober 2021.

TOP 10 EINZELWERTE

| Aktien | Land | Sektor | Bloomberg Code | Währung | Gewichtung |
|---------------------------------|-------------|--|----------------|---------|------------|
| VALEO | Frankreich | Zyklische Konsumgüter & Dienstleistungen | FR FP Equity | EUR | 2.36% |
| SODEXO | Frankreich | Zyklische Konsumgüter & Dienstleistungen | SW FP Equity | EUR | 2.33% |
| SOCIETE GENERALE | Frankreich | Finanzen | GLE FP Equity | EUR | 2.25% |
| EDP RENOVAVEIS | Portugal | Energie | EDPR PL Equity | EUR | 2.19% |
| ASSICURAZIONI GENERALI | Italien | Finanzen | G IM Equity | EUR | 2.14% |
| MUENCHENER RUCK. | Deutschland | Finanzen | MUV2 GY Equity | EUR | 2.14% |
| HERMES INTL. | Frankreich | Zyklische Konsumgüter & Dienstleistungen | RMS FP Equity | EUR | 2.13% |
| RANDSTAD | Niederlande | Industrie | RAND NA Equity | EUR | 2.13% |
| EDP ENERGIAS DE PORTUGAL | Portugal | Energie | EDP PL Equity | EUR | 2.12% |
| KLEPIERRE REIT | Frankreich | Finanzen | LI FP Equity | EUR | 2.12% |

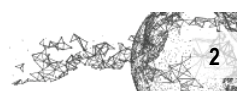
Quelle: BNP Paribas zum 31. Oktober 2021.

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.

