

BNP PARIBAS EQUITY JAPAN CLIMATE CARE NTR INDEX



MERKBLATT (FACTSHEET) | OKTOBER 2021

Der Index ist an die Performance japanischer 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.

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

Investmentuniversum: Vigeo Eiris Japan 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-, Pornografiegeschäften 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 1 Milliarden japanische Yen 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 Japan Universe abweichen

Die endgültige Auswahl des Portfolios muss folgende Kriterien erfüllen:

 5% Jährlich

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

 -50%

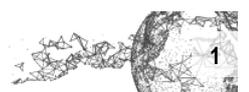
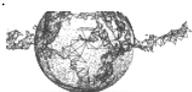
Es hat einen um mindestens 50% reduzierten CO₂-Fußabdruck im Vergleich zum Vigeo Eiris Japan Universe

 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 JAPAN CLIMATE CARE NTR INDEX bezieht
²Das „Vigeo Eiris Japan Universe“ besteht aus allen Aktien des ursprünglichen Universums von Vigeo Eiris mit der geografischen Eingrenzung auf Japan. Die Gewichtung jeder Aktie innerhalb des Vigeo Eiris Japan Universe ist proportional zur sich im Streubesitz befindenden Marktkaufkapitalisierung.



INDEXMERKMALE



Währung
EUR

Ticker
BNPIJPCC Index

Live Datum
27. März 2020



Net Total
Return

Barausschüttungen wie
Dividenden werden in
den Index reinvestiert



Quartalsweises
Rebalancing

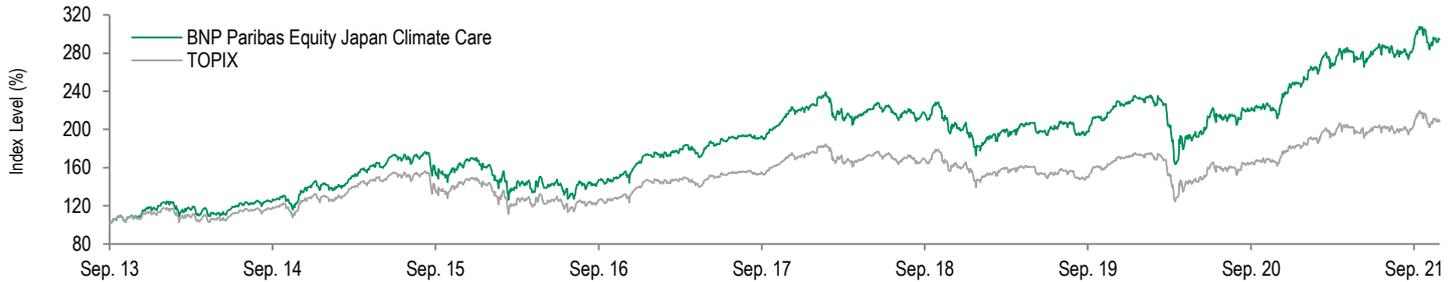
Ende März, Juni,
September
und Dezember



Langjährige
Partnerschaft

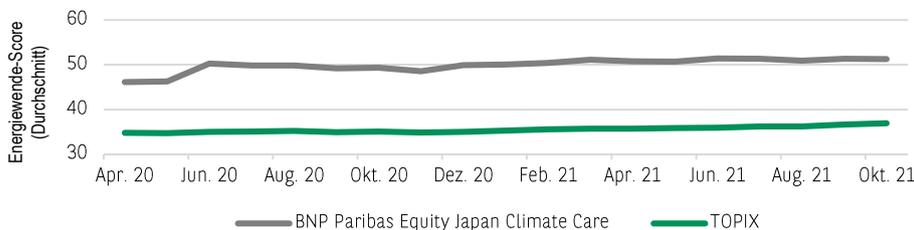
Vigeo Eiris ist ein
globaler Anbieter von
ESG Forschung und
Dienstleistungen

PERFORMANCE



Sep 13 – Okt 21	BNP Paribas Equity Japan Climate Care	TOPIX
Annualisierte Performance	14.13%	9.43%
Annualisierte Volatilität	19.65%	18.45%
Sharpe Ratio	0.72	0.51
Korrelation	0.98	
Maximaler Drawdown	-31.51%	-32.66%

Quellen: Bloomberg, BNP Paribas zum 31. Oktober 2021. Vergleichsindex: TOPIX Net Total Return Index, Bloomberg Code: <TPXNTR Index>. Die Indizes wurden am 02. September 2013 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 Japan Climate Care Index liegt deutlich über dem Energiewende-Score für den TOPIX. 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
HITACHI CON.MCH.	Japan	Industrie	6305 JT Equity	JPY	2.31%
FUJI ELECTRIC	Japan	Industrie	6504 JT Equity	JPY	2.25%
DENSO	Japan	Zyklische Konsumgüter & Dienstleistungen	6902 JT Equity	JPY	2.20%
ORIENTAL LAND	Japan	Zyklische Konsumgüter & Dienstleistungen	4661 JT Equity	JPY	2.16%
TOYOTA TSUSHO	Japan	Industrie	8015 JT Equity	JPY	2.13%
SCREEN HOLDINGS	Japan	Technologie	7735 JT Equity	JPY	2.12%
DAI NIPPON PRINTING	Japan	Industrie	7912 JT Equity	JPY	2.11%
CHUGAI PHARM.	Japan	Gesundheitswesen	4519 JT Equity	JPY	2.11%
HITACHI	Japan	Nicht zyklische Verbrauchsgegenstände	6501 JT Equity	JPY	2.10%
NOMURA RESEARCH INST.	Japan	Technologie	4307 JT Equity	JPY	2.09%

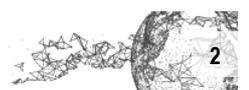
Quelle: BNP Paribas zum Oktober 2021.

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 TOPIX-Indexwert und die TOPIX-Marken unterliegen den Eigentumsrechten der Tokyo Stock Exchange, Inc. Des Weiteren besitzt die Tokyo Stock Exchange, Inc. alle Rechte und das Know-how in Bezug auf den TOPIX, bezogen auf die Berechnung, Veröffentlichung und Nutzung des TOPIX Indexwerts und die TOPIX Marken. Kein Produkt wird in irgendeiner Weise von der Tokyo Stock Exchange, Inc. gesponsert, empfohlen oder beworben.

© 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.

