



BNP PARIBAS EQUITY US CLIMATE CARE NTR INDEX



MERKBLATT (FACTSHEET) | OKTOBER 2021

Der Index ist an die Performance amerikanischer 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 US Universe²
- Der erwartete Tracking Error im Vergleich zu dem Vigeo Eiris US Universe darf 5% pro Jahr nicht überschreiten

Investmentuniversum: Vigeo Eiris US 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 U.S. Dollar liegen
- **Gewichtung:** Die Gewichtung jeder einzelnen Aktie muss zwischen 0% und 2% 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 US Universe abweichen

Die endgültige Auswahl des Portfolios muss folgende Kriterien erfüllen:



5% Jährlich

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



-50%

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



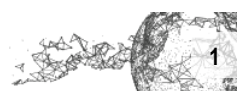
Max.

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 US CLIMATE CARE NTR INDEX bezieht

²Das „Vigeo Eiris US Universe“ besteht aus allen Aktien des ursprünglichen Universums von Vigeo Eiris mit der geografischen Eingrenzung auf die USA. Die Gewichtung jeder Aktie innerhalb des Vigeo Eiris US Universe ist proportional zur sich im Streubesitz befindenden Markt kapitalisierung.



INDEXMERKMALE



Währung
EUR

Ticker
BNPIUSCC Index

Live Datum
27. März 2020



Net Total
Return

Barausschüttungen wie
Dividenden werden in
den Index reinvestiert



Quartalsweises
Rebalancing

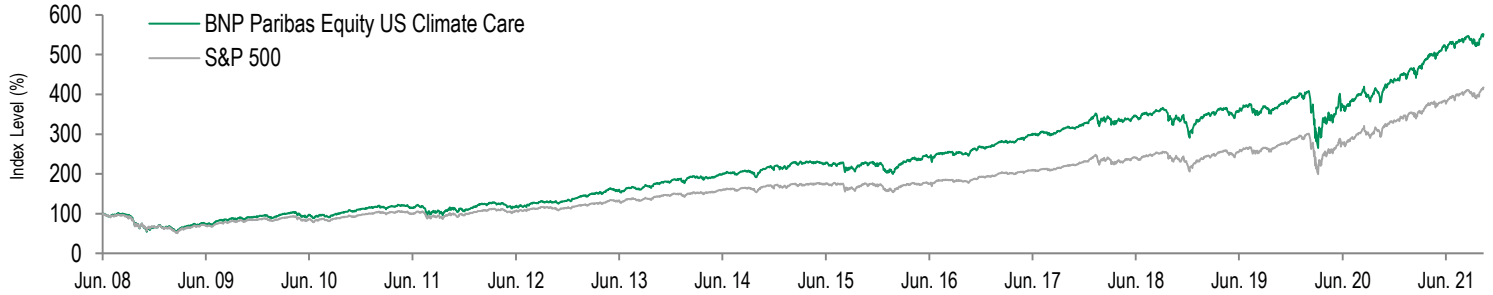
Ende März, Juni,
September
und Dezember



Langjährige
Partnerschaft

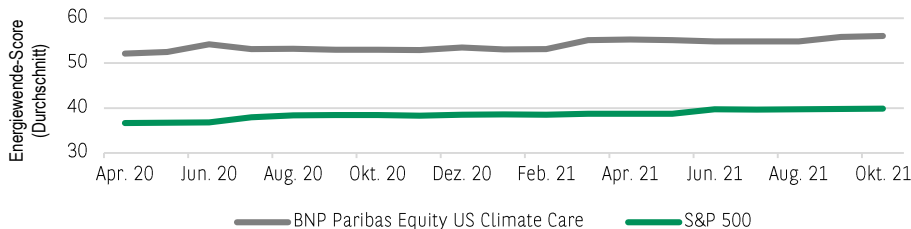
Vigeo Eiris ist ein
globaler Anbieter von
ESG Forschung und
Dienstleistungen

PERFORMANCE



Jun 08 - Okt 21	BNP Paribas Equity US Climate Care	S&P 500
Annualisierte Performance	13.60%	11.28%
Annualisierte Volatilität	21.87%	20.73%
Sharpe Ratio	0.62	0.54
Korrelation	0.98	
Maximaler Drawdown	-46.81%	-48.91%

Quellen: Bloomberg, BNP Paribas zum 31. Oktober 2021. Vergleichsindex: S&P 500 Net Total Return Index, Bloomberg Code: <SPTR500N 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 US Climate Care Index liegt deutlich über dem Energiewende-Score für den S&P 500. Die Daten werden monatlich zur Verfügung gestellt. Quelle: BNP Paribas, Vigeo Eiris, Stand 31. Oktober 2021.

TOP 10 EINZELWERTE

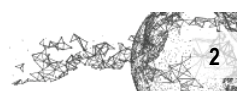
Aktien	Land	Sektor	Bloomberg Code	Währung	Gewichtung
CSX	Vereinigte Staaten	Industrie	CSX UW Equity	USD	2.32%
NVIDIA	Vereinigte Staaten	Technologie	NVDA UW Equity	USD	2.29%
ADVANCED MICRO DEVICES	Vereinigte Staaten	Technologie	AMD UW Equity	USD	2.25%
SALESFORCE.COM	Vereinigte Staaten	Technologie	CRM UN Equity	USD	2.24%
UNITED PARCEL SER. B'	Vereinigte Staaten	Industrie	UPS UN Equity	USD	2.17%
INTUIT	Vereinigte Staaten	Technologie	INTU UW Equity	USD	2.16%
PROLOGIS REIT	Vereinigte Staaten	Finanzen	PLD UN Equity	USD	2.16%
AUTODESK	Vereinigte Staaten	Technologie	ADSK UW Equity	USD	2.15%
HP	Vereinigte Staaten	Technologie	HPQ UN Equity	USD	2.14%
ELI LILLY	Vereinigte Staaten	Gesundheitswesen	LLY UN Equity	USD	2.14%

Quelle: BNP Paribas zum 31. Oktober 2021.
Es gilt zu beachten, dass die Obergrenze von 2% 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 S&P500® ist ein Produkt von S&P Dow Jones Indices LLC („SPDJ“), und wurde zur Verwendung an BNP Paribas S.A. und an jede von BNP Paribas S.A. gehaltene Tochtergesellschaft lizenziert. Standards & Poor's® und S&P® sind eingetragene Handelsmarken von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“); Dow Jones® ist eine eingetragene Handelsmarke von Dow Jones Trademark Holdings LLC („Dow Jones“); und diese Handelsmarke wurde an SPDJI zur Nutzung und für bestimmte Zwecke zur Unterlizenzierung lizenziert. Die Wertpapiere des Lizenznehmers werden von SPDJI, Dow Jones, S&P, und ihren jeweiligen verbundenen Unternehmen weder gesponsert, unterstützt, verkauft oder vertrieben und keine dieser Parteien nimmt Stellung dazu, ob eine Anlage in die Wertpapiere anzuraten ist. Der Lizenzgeber übernimmt keine Haftung für Fehler in den Berechnungen, Auslassungen oder Unterbrechungen in der Berechnung des S&P500

© 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.

