

Gemanagtes Portfolio ESG-Portfolio 5

Stuttgarter Info-Service

30. Juni 2022

Strategie

Die langfristig chancenorientierte Anlagestrategie hat langfristiges Kapitalwachstum zum Ziel. Sehr hohe Kapitalmarktverluste sind möglich. Damit sind auch die Renditechancen sehr hoch. Das Portfolio setzt sich aus verschiedenen offenen Investmentfonds zusammen. Die Auswahl der Fonds erfolgt anhand ökologischer, sozialer und ethischer Kriterien. In der Anlagepolitik der Fonds sind z.B. ESG-Kriterien ("Environmental", "Social", "Governance") oder Ansätze des ethischen Investments („SRI“: Socially Responsible Investment) berücksichtigt. Zudem sind Fonds mit Fokus auf Branchen mit ökologischer, sozialer oder ethischer Wirkung (z.B. Wasser, Gesundheitswesen, erneuerbare Energien) enthalten. Bei den Investmentfonds handelt es sich größtenteils um ETF (Exchange Traded Fund, börsenhandelter Indexfonds, der die Wertentwicklung eines Index abbildet). Es können auch aktiv gemanagte Fonds eingesetzt werden. Die Zusammensetzung des Portfolios erfolgt anhand eines mathematischen Verfahrens und wird regelmäßig angepasst. Die Anlagestrategie des ESG-Portfolio 5 strebt die Erwirtschaftung einer attraktiven, risikoadjustierten Wertentwicklung an. Die Anlagepolitik ist darauf ausgerichtet, in viele Branchen und Regionen an den weltweiten Kapitalmärkten zu investieren. Das Risiko des Portfolios wird mit der Risikokennzahl „Conditional Value at Risk“ aktiv gesteuert. Conditional Value at Risk beschreibt hier den maximalen Verlust, den das Portfolio durchschnittlich in einem definierten Zeitkorridor erreichen könnte. Die Begrenzung des Verlustes kann nicht zugesichert werden. Unser Ziel ist es, das Chance-Risiko-Verhältnis des Portfolios langfristig stabil zu halten. Deshalb können wir die Risikokennzahl für das Portfolio an Marktveränderungen anpassen.

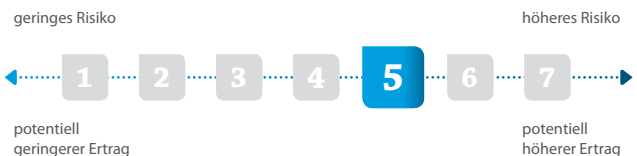
Basisdaten

Fonds-Nr. / ISIN	620 / XXESGPORTFO5
Auflagedatum	01.11.2020
Ertragsverwendung	thesaurierend

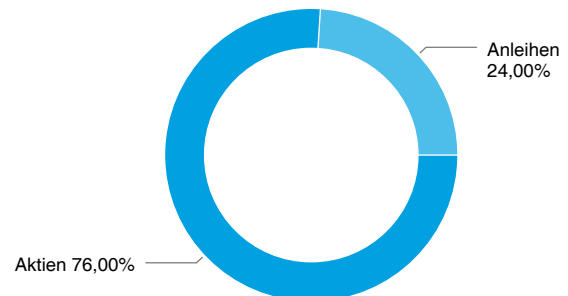
Kosten

Laufende Kosten	0,51 % (16.05.2022)
Rückvergütung	0,00 %

Risikoklasse nach KIID



Portfolioaufteilung (01. Mai 2022)



Portfolioaufteilung im Detail: (01. Mai 2022)

Aktien	76,00%
RobecoSAM Sustainable Healthy Living Equities I EUR (LU2146190165)	11,92%
Xtrackers MSCI USA ESG UCITS ETF 1C (IE00BFMNPS42)	10,28%
Schroder ISF Global Climate Change Equity USD C Acc (LU0302446132)	9,50%
Amundi Index MSCI Europe SRI PAB - UCITS ETF DR - EUR (C) (LU1861137484)	9,41%
Amundi Index MSCI Emerging Markets SRI PAB - UCITS ETF DR (C) (LU1861138961)	8,90%
DPAM B Equities NewGems Sustainable W EUR (BE6246061376)	7,99%
BlackRock Global Funds - BGF Sustainable Energy Fund D2 EUR (LU0252964944)	7,22%
Xtrackers MSCI Japan ESG UCITS ETF 1C (IE00BG36TC12)	6,06%
HSBC ETFs PLC - HSBC Asia Ex Japan Sustainable Equity UCITS ETF USD (IE00BKY58G26)	4,72%
Anleihen	24,00%
Candriam Sustainable - Bond Euro - C Part (I) (LU1313769793)	8,00%
Lyxor Green Bond (DR) UCITS ETF EUR Acc (LU1563454310)	8,00%
Amundi Index Euro Agg Corporate SRI - UCITS ETF DR EUR (A) (LU1437018168)	8,00%

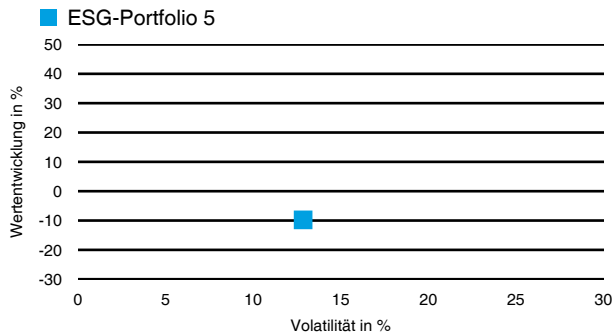
Diese Darstellung dient ausschließlich der Produktinformation und stellt weder eine Anlageberatung noch eine Produktempfehlung dar. Wertentwicklungsdarstellungen nach der BVI-Methode (ohne Berücksichtigung von Ausgabeaufschlägen). Historische Wertentwicklungen lassen keine Rückschlüsse auf eine ähnliche Entwicklung in der Zukunft zu. Diese sind nicht prognostizierbar. Weitergehende Informationen sind den gesetzlichen Pflichtveröffentlichungen der Fondsgesellschaft zu entnehmen, die Sie bei uns kostenlos anfordern können.

Gemanagtes Portfolio ESG-Portfolio 5

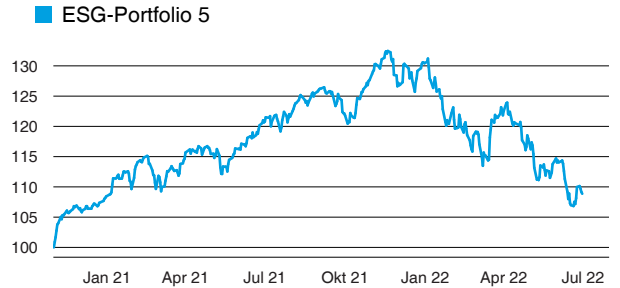
Stuttgarter Info-Service

30. Juni 2022

1 Jahres Risiko Rendite Diagramm



Wertentwicklung (indexiert)



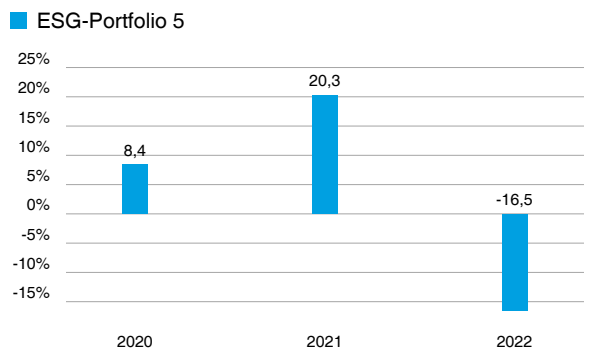
Performance (30.06.2022)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	Seit Auflage
Fonds	-9,77 %	-	-	+8,86 %

Performance p.a. (30.06.2022)

	1 Jahr p.a.	3 Jahre p.a.	5 Jahre p.a.	Seit Auflage p.a.
Fonds	-9,77 %	-	-	+5,25 %

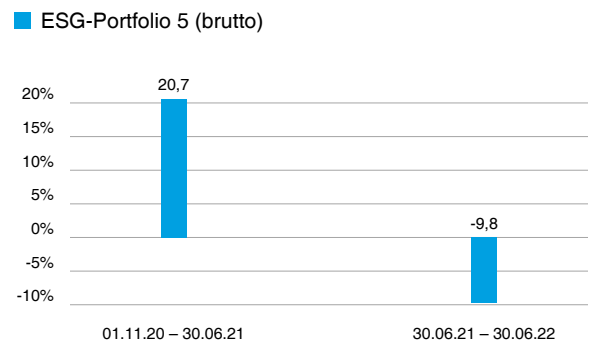
Wertentwicklung nach Kalenderjahren



Quelle: CleverSoft FondsDB™

Stand: 30.06.2022

Rollierende Wertentwicklung



Quelle: CleverSoft FondsDB™

Stand: 30.06.2022

Kennzahlen

Sharpe Ratio (1 Jahr)	-0,74
1-Monats-Tief in %	-6,33

Volatilität

	1 Jahr	5 Jahre	10 Jahre	Seit Auflage
Volatilität	12,87 %	-	-	11,48 %

ESG Information

Stand: 01.07.2022

Name der Anlageoption	ESG-Portfolio 5
Identifikation der Anlageoption	ISIN: XXESGPORF05 / WKN: 000000
Hersteller	-
Link zu den Nachhaltigkeits-Informationen des Herstellers	Link
Index als Referenzwert	Es gibt keinen Referenzindex zum ESG-Portfolio
Beschreibung zur Berechnung der Methode des Index	Es gibt keinen Referenzindex zum ESG-Portfolio
Einstufung nach Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor	Artikel 8
BVI Kategorisierung*	E
Stichtag der letzten Aktualisierung durch den Asset Manager (Hersteller)	10.03.2021

*Skala: O = Kein ESG Fonds, B = ESG Basic Fonds, E = ESG Fonds, I = Impact Fonds

Die offengelegten ESG-Informationen werden der cleversoft GmbH von der genannten Kapitalanlagegesellschaft (Hersteller) zur Verfügung gestellt. Die ESG-Informationen werden mit größtmöglicher Sorgfalt erstellt, regelmäßig geprüft und aktualisiert. Trotz aller Sorgfalt können sich die Informationen inzwischen verändert haben oder auf fehlerhaften Daten Dritter basieren. Die Versicherungsgesellschaft und cleversoft GmbH können keine Gewähr für die Richtigkeit, Vollständigkeit und Aktualität der ausgewiesenen Daten übernehmen. Die in dem ESG-Dokument publizierten Informationen stellen keine Empfehlung, Angebot oder Aufforderung zur Investition in einen Fonds dar.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Welche Anlageziele verfolgt das Produkt, um Nachhaltigkeit zu erfüllen?

Das ESG-Portfolio verfolgt das Anlageziel, ökologische, soziale und ethische Kriterien in der Geldanlage zu berücksichtigen. Es gibt dabei kein einheitliches Anlageziel, weil mehrere Fonds mit unterschiedlichen ESG-Strategien kombiniert werden. Weitere Informationen finden Sie im Factsheet oder unter www.stuttgarter.de/service/fondsauswahl

Welche ökologischen und sozialen Merkmale werden erfüllt?

In der Anlagepolitik der im ESG-Portfolio enthaltenen Fonds sind z.B. ESG-Kriterien ("Environmental", "Social", "Governance") oder Ansätze des ethischen Investments („SRI“: Socially Responsible Investment) berücksichtigt. Zudem sind Fonds mit Fokus auf Branchen mit ökologischer, sozialer oder ethischer Wirkung (z.B. Wasser, Gesundheitswesen, erneuerbare Energien) enthalten.

Wie wird die Nachhaltigkeitsstrategie umgesetzt?

Das Portfolio kombiniert Fonds mit unterschiedlichen Nachhaltigkeitsstrategien. Es werden verschiedene Indizes mit SRI-Ansätzen abgebildet. Ergänzt durch nachhaltige Themenansätze wie sauberes Wasser und nachhaltige Energiegewinnung, Klimawandel und nachhaltige Gesundheitsthemen.

Datenquellen und Kriterien für die Bewertung der zugrunde liegenden Vermögenswerte

Angabe der Asset-Manager der einzelnen Fonds innerhalb des Portfolios

Relevante Nachhaltigkeitsindikatoren, die zur Messung der ökologischen oder sozialen Merkmale oder der Gesamtnachhaltigkeitsauswirkungen des Finanzprodukts herangezogen wurden

Spezielle Nachhaltigkeitsindikatoren werden derzeit nicht herangezogen.

Wird mit dem Finanzprodukt eine Reduzierung der CO₂-Emission angestrebt?

Bei einigen Fonds des Portfolios wird eine Reduzierung der CO₂-Emission angestrebt

Angaben dazu, wie der bestimmte Index auf das angestrebte Ziel ausgerichtet ist

Es gibt keinen Referenzindex zum ESG-Portfolio

Warum unterscheidet sich der Index von einem Marktindex?

Es gibt keinen Referenzindex zum ESG-Portfolio

ESG Information

Welche Nachhaltigkeitskriterien werden mit einbezogen?

Es werden Positiv- wie Negativ-Kriterien angewendet. Grundsätzlich werden Investitionen in Unternehmen getätigt, die ein erstklassiges Rating in den Bereichen Umwelt, soziale Verantwortung und Grundsätze guter Unternehmensführung (ESG) haben. Weiterhin finden sich Best-in-class-Ansätze und ESG Leader-Ansätze in dem Portfolio. Viele Fonds nehmen Mitbestimmungsrechte bei den Unternehmen wahr (Engagement). Vereinzelt wird eine Messung der Verbesserung bestimmter ESG Kriterien im Portfolio angewendet.

Sind bestimmte Investitionen ausgeschlossen?

Kontroverse Waffen, Rüstung Alkohol, Tabak, Unternehmen mit schwerwiegenden ESG- Kontroversen Verstöße gegen die globalen Richtlinien der UN Vereinzelt: Pornographie Gentechnik Atomkraft Kraftwerkskohle und thermische Kohle Glücksspiel Unkonventionelle Öl- und Gasförderung

Zu welchen Umweltzielen trägt das Finanzinstrument bei?

Es wurden noch keine Angaben von dem Hersteller des Produktes zur Verfügung gestellt.

Welche Wirtschaftstätigkeiten sind als ökologisch nachhaltig einzustufen? Welchen Anteil an Investitionen decken diese ab? (%)

Es wurden noch keine Angaben von dem Hersteller des Produktes zur Verfügung gestellt.

Welche Wirtschaftstätigkeiten sind ermöglichende und welche Übergangstätigkeiten? Welchen Anteil der ökologisch nachhaltigen Investitionen sind ermöglichende Tätigkeiten und welchen Anteil davon sind Übergangstätigkeiten? (%)

Es wurden noch keine Angaben von dem Hersteller des Produktes zur Verfügung gestellt.