

# Musterdepot / Zielmarktportfolio ETF AUSGEWOGEN

15.06.2023

## Basisinformationen

### Startdatum

01.01.2018

### Beschreibung

### Kenntnisse & Erfahrungen

-

### Anlagehorizont

-

### Durchschnitts-SRI

3,86

### Höchste SRI

6

## Instrumente

Instrumentenname ISIN/WKN	SRI	Rendite lfd. Jahr	Rendite s. Auflage p.a.	Rendite 1J	Rendite 3J p.a.	Rendite 5J p.a.	ESG Score U	ESG Score S	Sharpe Ratio	MWV	Gewichtung
<b>Amundi Index Solutions - Amundi MSCI Em Asia UCITS ETF-C EUR</b> LU1681044480 / A2H58R	4	4,62 %	5,11 % 22.03.2018	-3,56 %	3,66 %	1,53 %	26,13 / 50	- / 50	0,32	-33,18 %	6,00 %
<b>BNP Paribas Easy ECPI Global ESG Infrastructure UCITS ETF Capitalisation</b> LU1291109293 / A2ACQY	4	7,13 %	6,27 % 05.02.2016	4,31 %	6,67 %	5,68 %	20,27 / 50	- / 50	0,58	-17,71 %	6,00 %
<b>iShares \$ TIPS UCITS ETF EUR Hedged (Acc)</b> IE00BDZVH966 / A2JDYH	3	0,62 %	0,42 % 05.03.2018	-3,90 %	-1,77 %	0,42 %	- / 50	13,44 / 50	-0,22	-16,61 %	5,00 %
<b>iShares Automation &amp; Robotics UCITS ETF USD (Acc)</b> IE00BYZK4552 / A2ANH0	4	25,59 %	14,55 % 08.09.2016	25,82 %	14,30 %	10,22 %	21,34 / 50	- / 50	0,72	-35,70 %	6,00 %
<b>iShares Global Corp Bond UCITS ETF USD (Dist)</b> IE00B7J7TB45 / A1J0YD	2	1,29 %	2,73 % 24.09.2012	-1,22 %	-2,42 %	1,65 %	22,95 / 50	14,77 / 50	-0,26	-12,42 %	2,50 %
<b>iShares Global High Yield Corp Bond UCITS ETF USD (Dist)</b> IE00B74DQ490 / A1J7MG	3	3,39 %	4,43 % 13.11.2012	4,38 %	2,47 %	2,81 %	- / 50	- / 50	0,52	-9,67 %	5,00 %
<b>iShares J.P. Morgan \$ EM Corp Bond UCITS ETF USD (Dist)</b> IE00B6TLBW47 / A1JWS3	2	1,04 %	4,71 % 17.04.2012	-0,33 %	0,14 %	3,41 %	28,43 / 50	27,55 / 50	0,11	-9,62 %	5,00 %
<b>iShares MSCI Japan SRI UCITS ETF</b> IE00BYX8XC17 / A2AUE9	4	11,94 %	- 02.03.2017	13,07 %	6,33 %	4,53 %	21,52 / 50	- / 50	0,47	-22,20 %	5,00 %
<b>iShares STOXX Europe 600 Personal &amp; Household Goods UCITS ETF (DE)</b> DE000A0H08N1 / A0H08N	4	14,25 %	9,12 % 08.07.2002	26,54 %	12,15 %	7,70 %	17,55 / 50	- / 50	0,72	-21,95 %	6,00 %
<b>JPMorgan ETFs (Ireland) ICAV - USD Emerging Markets Sovereign Bond UCITS ETF USD (dist)</b> IE00BDFC6G93 / A2JBL7	3	1,18 %	3,15 % 15.02.2018	2,70 %	-1,02 %	2,68 %	41,48 / 50	24,92 / 50	-0,04	-13,56 %	2,50 %
<b>L&amp;G Clean Energy UCITS ETF USD Acc</b> IE00BK5BCH80 / A2QFEN	6	0,74 %	6,06 % 11.11.2020	5,57 %	-	-	23,99 / 50	- / 50	0,38	-22,92 %	6,00 %
<b>L&amp;G Clean Water UCITS ETF</b> IE00BK5BC891 / A2PM52	5	10,08 %	13,24 % 26.06.2019	14,86 %	16,67 %	-	24,67 / 50	- / 50	1,03	-20,34 %	6,00 %

<b>Lyxor Core Euro Government Inflation-Linked Bond (DR) UCITS ETF - Acc</b> LU1650491282 / LYX0XL	3	3,11 %	2,66 % 23.11.2017	1,72 %	1,70 %	1,33 %	- / 50	14,60 / 50	0,27	-15,83 %	5,00 %
<b>Lyxor FTSE Epra/Nareit Global Developed UCITS ETF D EUR Inc</b> LU1832418773 / LYX0Y2	4	-0,30 %	7,00 % 08.11.2018	-6,06 %	3,20 %	-	15,99 / 50	- / 50	0,29	-26,97 %	5,00 %
<b>Lyxor MSCI World Health Care TR UCITS ETF - C-EUR</b> LU0533033238 / LYX0GM	4	-2,24 %	13,39 % 19.08.2010	6,71 %	10,04 %	10,71 %	25,76 / 50	- / 50	0,79	-13,49 %	6,00 %
<b>Lyxor MSCI World Information Technology TR UCITS ETF - C-EUR</b> LU0533033667 / LYX0GP	5	35,20 %	18,87 % 16.08.2010	30,81 %	19,15 %	18,77 %	17,55 / 50	- / 50	0,81	-29,34 %	6,00 %
<b>SPDR Refinitiv Global Convertible Bond UCITS ETF</b> IE00BNH72088 / A12CZS	3	5,49 %	6,64 % 14.10.2014	4,41 %	4,54 %	5,10 %	23,23 / 50	- / 50	0,44	-20,61 %	2,50 %
<b>Xtrackers II Global Government Bond UCITS ETF 5C</b> LU0908508731 / DBX0NM	3	0,02 %	1,35 % 14.08.2013	-4,38 %	-5,65 %	-0,81 %	- / 50	13,74 / 50	-0,77	-16,97 %	2,50 %
<b>Xtrackers MSCI World Consumer Staples UCITS ETF 1C</b> IE00BM67HN09 / A113FG	4	1,07 %	8,23 % 09.03.2016	6,96 %	9,47 %	8,39 %	23,43 / 50	- / 50	0,83	-12,04 %	6,00 %
<b>Xtrackers MSCI World Quality UCITS ETF 1C</b> IE00BL25JL35 / A1103D	4	11,82 %	10,77 % 11.09.2014	14,32 %	12,98 %	10,37 %	20,78 / 50	- / 50	0,85	-18,58 %	6,00 %

## Wertentwicklung

● Zielmarktportfolio ETF AUSGEWOGEN



## Jährliche Wertentwicklung in %



## Wertentwicklung in %

Zeitgewichtete Methode

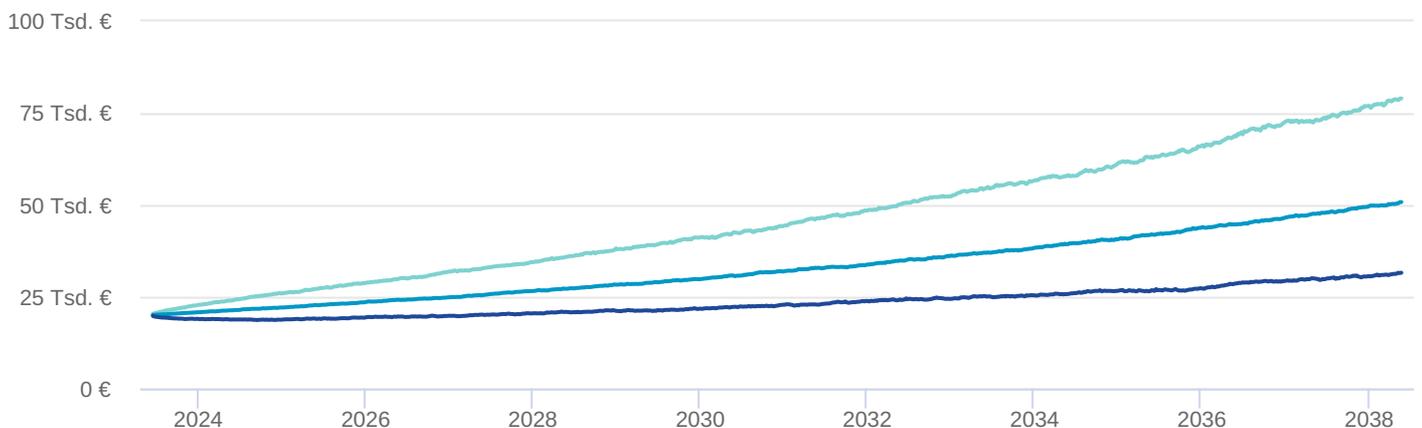
	Annualisiert	Kumuliert
1 Monat	-	2,00 %
3 Monate	-	4,26 %
6 Monate	-	5,62 %
Lfd. Jahr	-	7,66 %
1 Jahr	-	7,87 %
3 Jahre	7,80 %	25,28 %
5 Jahre	6,79 %	38,87 %
10 Jahre	-	-
Seit Auflage am 01.01.2018	6,81 %	43,24 %

## Mögliche Wertentwicklung 15 Jahre

Insgesamt eingezahlt **20,00 Tsd. EUR**

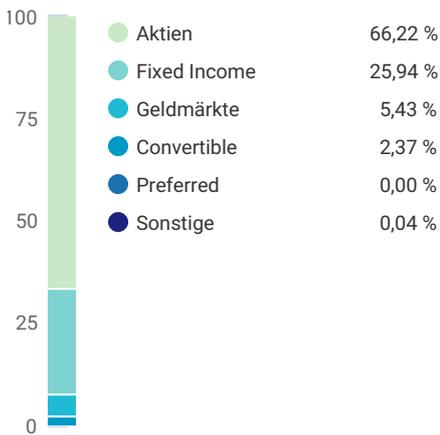
- Starke Wertentwicklung: **79,03 Tsd. EUR** (9,59 % p.a.)
- Durchschnittliche Wertentwicklung: **50,79 Tsd. EUR** (6,41 % p.a.)
- Schlechte Wertentwicklung: **31,53 Tsd. EUR** (3,08 % p.a.)

Depot- und Transaktionskosten (wie z.B. Ausgabeaufschlag) sind in der Berechnung nicht berücksichtigt

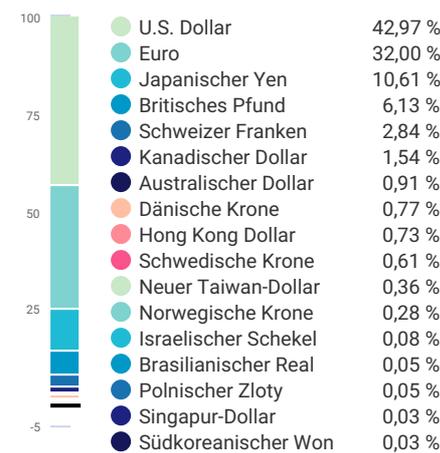


# Portfoliostruktur

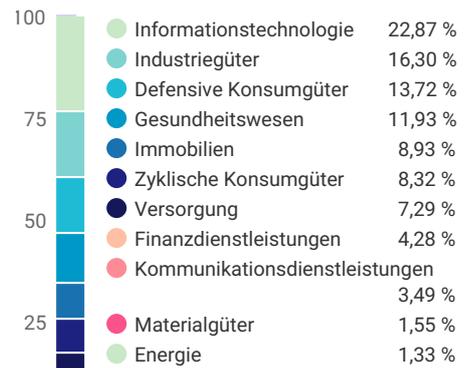
## Assetklassen



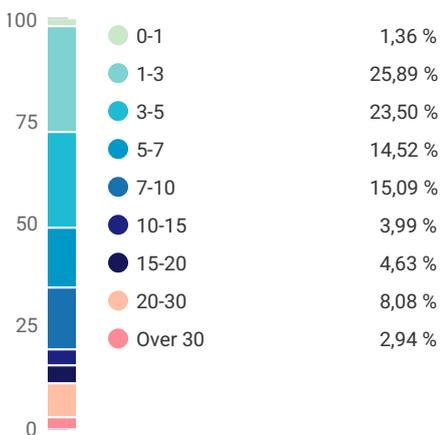
## Währungen



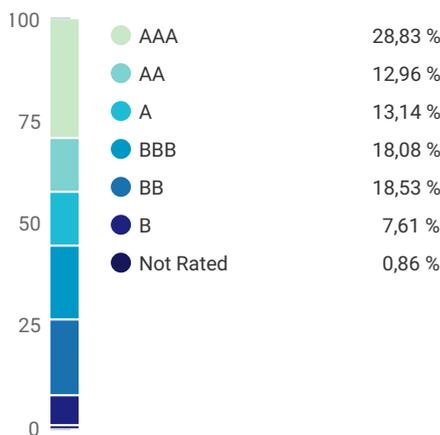
## Branchen



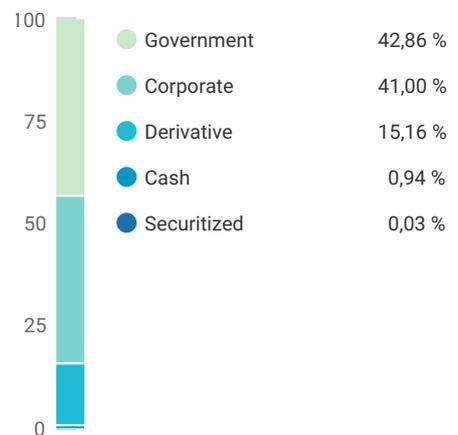
## Restlaufzeiten



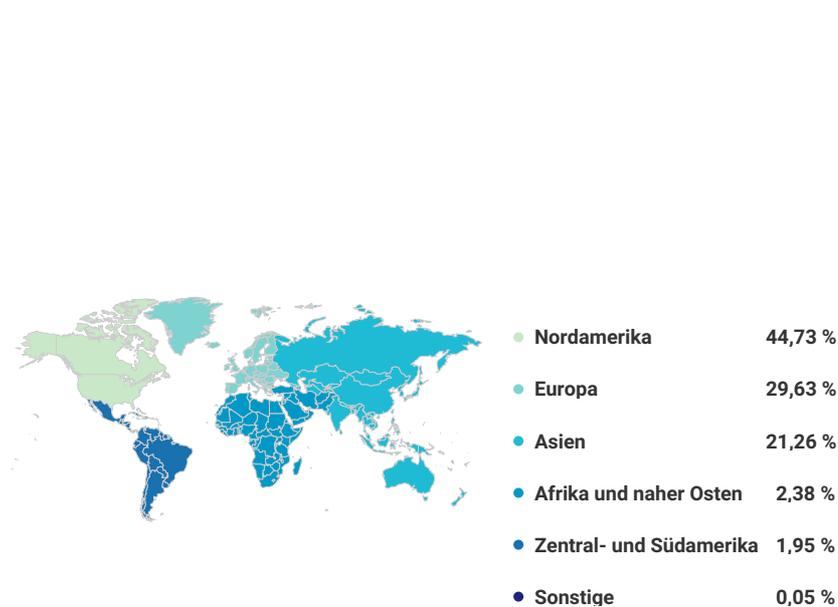
## Kreditqualitäten der Emittenten



## Emittentenstruktur



## Regionen



## Top 10 Instrumente

TRS MSCI EM Asia NR USD	6,00 %
TRS MSCI World/Health Care NR USD	6,00 %
TRS MSCI World/Information Tech NR USD	6,00 %
TRS FTSE EPRA Nareit Developed NR USD	4,56 %
TREASURY (CPI) NOTE	1,47 %
LVMH	1,38 %
UNILEVER PLC	1,00 %
LOREAL SA	0,80 %
Nestlé Reg.	0,64 %
The Procter & Gamble	0,53 %

## Kennzahlen

Expected Shortfall

**24,57 %**

Sharpe Ratio

**0,55**

Benchmark -

Tracking Error

Keine Benchmark  
gesetzt

Information Ratio

Keine Benchmark  
gesetzt

Alpha

Keine Benchmark  
gesetzt

Beta

Keine Benchmark  
gesetzt

Rendite

**43,24 %**

Rendite p.a.

**6,81 %**

Historischer  
Value at Risk  
(VaR)<sup>1</sup>



Volatilität<sup>2</sup>



Maximaler  
Wertverlust<sup>3</sup>



<sup>1</sup> Der Value at Risk ist eine Kennzahl bzw. eine darauf gestützte Methode zur Quantifizierung, insbesondere der Markt- und Preisrisiken von Kassa- oder derivativen (Finanz-)Instrumenten, sowie Adressausfallrisiken bei Kreditinstrumenten.

<sup>2</sup> Die Volatilität misst die Intensität der Schwankungen eines Fonds innerhalb eines Jahres um den eigenen Mittelwert.

<sup>3</sup> Der Maximaler Verlust ist eine Kennzahl, die den größten prozentualen Wertverlust eines Fonds innerhalb eines bestimmten Zeitraums angibt. Der Wert entspricht der Rendite vom teuersten Kurs zum billigsten Kurs im betrachteten Zeitintervall.

Zeitraum der Wertaufholung: 245 Tage

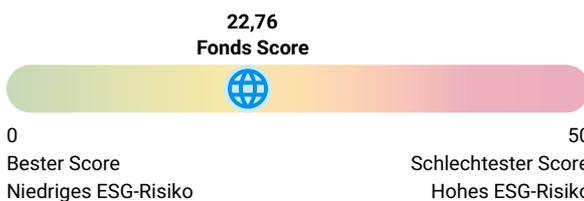
Datum des maximalen Wertverlust 23.03.2020

Erholungsdatum 23.11.2020

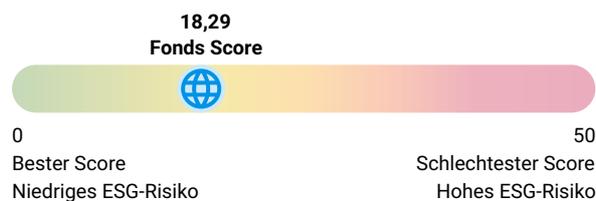
[Portfolio](#)

## Nachhaltigkeitsanalyse (ESG)

Morningstar Historischer Sustainability Score  
(Unternehmen)<sup>4</sup>



Morningstar Historischer Sustainability Score  
(Staaten)<sup>4</sup>



ESG-Pfeiler<sup>5</sup>

Umwelt	4,35
Soziales	8,15
Governance	6,30

<sup>4</sup> Der historische Morningstar Nachhaltigkeits-Score ist ein gewichteter Durchschnitt der letzten 12 Monate der Morningstar Portfolio Nachhaltigkeits-Scores. Es wird nach Risiken für Unternehmen und Risiken für Staaten differenziert. Die Scores der beiden Unterrisiken werden dann zu einem Gesamtscore zusammengeführt. Hierbei werden die Scores aus der jüngeren Vergangenheit stärker gewichtet als ältere Scores des 12-Monats-Zeitraums. Basierend auf dem Historischen Morningstar Nachhaltigkeits-Score werden den Fonds absolute Kategorien und prozentuale Ränge innerhalb der Morningstar Global Categories zugewiesen. Das bedeutet, dass durch den Ausweis absoluter Zahlen ein Fonds auch über Fondskategorien bzw. Vergleichsgruppen hinweg vergleichbar wird.

<sup>5</sup> Umwelt: Der nach Vermögenswerten gewichtete Durchschnitt des Unternehmens-Umweltrisiko-Scores für die abgedeckten Bestände in einem Portfolio. Die Umweltrisiko-Scores von Sustainalytics messen das Ausmaß, in dem der wirtschaftliche Wert eines Unternehmens durch Umweltfaktoren gefährdet sein kann. Das Umweltrisiko stellt das nicht gemanagte Umweltrisiko dar, nachdem das Management solcher Risiken durch ein Unternehmen berücksichtigt wurde. Die Umweltrisiko-Scores werden als Zahl zwischen 0 und 100 angezeigt, wobei die meisten Scores zwischen 0 und 25 liegen.

Soziales: Der vermögenswertgewichtete Durchschnitt des Company Social Risk Scores für die abgedeckten Bestände in einem Portfolio. Company Social Risk Scores von Sustainalytics messen das Ausmaß, in dem der wirtschaftliche Wert eines Unternehmens durch soziale Faktoren gefährdet sein kann. Das soziale Risiko stellt das nicht gemanagte soziale Risiko dar, nachdem das Management solcher Risiken durch ein Unternehmen berücksichtigt wurde. Die Social Risk Scores werden als Zahlen zwischen 0 und 100 angezeigt, wobei die meisten Scores zwischen 0 und 25 liegen.

Governance: Der nach Vermögenswerten gewichtete Durchschnitt des Unternehmens-Governance-Risiko-Scores für die abgedeckten Bestände eines Portfolios. Die Unternehmens-Governance-Risiko-Scores von Sustainalytics messen das Ausmaß, in dem der wirtschaftliche Wert eines Unternehmens aufgrund von Governance-Faktoren gefährdet sein kann. Das Governance-Risiko stellt das nicht gemanagte Governance-Risiko dar, nachdem das Management solcher Risiken durch ein Unternehmen berücksichtigt wurde. Die Governance-Risiko-Scores werden als Zahl zwischen 0 und 100 angezeigt, wobei die meisten Scores zwischen 0 und 25 liegen.

## RECHTLICHE HINWEISE

Eine positive Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein verlässlicher Indikator für eine zukünftige positive Wertentwicklung. Anleger erhalten daher unter Umständen nicht den investierten Betrag vollständig zurück. Dies kann bis zu einem Totalverlust des investierten Betrages reichen.

Die in diesem Dokument enthaltenen Informationen wurden sorgfältig ausgewählt und geprüft. Eine Gewähr für die Richtigkeit kann jedoch nicht gegeben werden.

Der Inhalt des Dokuments stellt weder eine individuelle Anlageempfehlung noch eine Einladung zur Zeichnung oder ein Angebot zum Kauf bzw. Verkauf von Anteilen der genannten Investmentfonds(-klassen) bzw. ein Angebot zum Abschluss der dargestellten Anlageprodukte oder Portfolioverwaltung dar. Das Dokument ersetzt keine sorgfältige Beratung durch einen kompetenten Berater. Alleinige Grundlage für eine Anlageentscheidung für Investmentfonds sind die Verkaufsunterlagen, das heißt der jeweilige Verkaufsprospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen, der aktuelle Jahresbericht sowie der aktuelle Halbjahresbericht.