

FACTSHEET - STAND 18.06.2024

Solactive Spain 40 Net Total Return Index

HISTORISCHE WERTENTWICKLUNG*



STAMMDATEN

ISIN / WKN	DE000SLA24B2 / SLA24B	Basiswert / Basisdatum	100 Points / 18.12.2009
Bloomberg / Reuters	SOLSP40P Index / .SOLSP40P	Aktueller Stand	94.82
Index Berechner	Solactive AG	Dividenden	Reinvested (Total Return Index)
Index Typ	Developed Markets	Berechnung	09:00am to 10:30pm (CET), every 15 seconds
Index Währung	EUR	Historie	Available daily back to 18.12.2009
Index Komponenten	40		

KENNZAHLEN

EUR	30T	90T	180T	360T	lfd. J	Seit Auflage
Performance	-3.53%	0.29%	9.00%	18.62%	8.85%	-5.18%
Performance (p.a.)						-0.37%
Volatilität (p.a.)	13.39%	14.24%	12.80%	12.50%	13.00%	21.99%
Hoch	98.55	98.55	98.55	98.55	98.55	105.37
Tief	93.73	92.26	86.04	77.30	86.04	50.08
Sharpe Ratio*	-2.92	-0.17	1.21	1.22	1.24	-0.18
Max. Drawdown	-4.89%	-5.57%	-5.57%	-7.93%	-5.57%	-52.47%
VaR 95 \ 99				-21.1% \ -29.7%		-33.9% \ -59.2%
CVaR 95 \ 99				-26.1% \ -32.9%		-52.6% \ -86.7%

* Bis einschließlich 31. Dezember 2021 werden ex-post Sharpe Ratios mittels des der Währung entsprechenden und laufeitenkongruenten LIBOR-Satzes berechnet. Ab 3. Januar 2022 werden die Sharpe Ratios über den relevanten risikolosen overnight-Satz berechnet, also SONIA (Britisches Pfund), SOFR (US Dollar) oder EURIBOR Overnight (Euro).

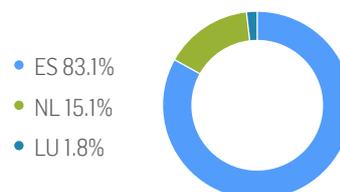
KENNZAHLEN - GBS - Solactive GBS Developed Markets Europe Large & Mid Cap EUR Index NTR

EUR	30T	90T	180T	360T	lfd. J	Seit Auflage
Performance	-0.99%	3.61%	10.48%	16.88%	9.97%	201.80%
Performance (p.a.)						7.92%
Volatilität (p.a.)	10.22%	9.13%	8.44%	9.61%	8.63%	16.46%
Hoch	1593.29	1593.29	1593.29	1593.29	1593.29	1593.29
Tief	1555.00	1495.00	1390.51	1276.62	1390.51	473.72
Sharpe Ratio*	-1.48	1.30	2.22	1.40	2.17	0.26
Max. Drawdown	-2.40%	-2.66%	-2.66%	-8.40%	-2.66%	-35.45%
VaR 95 \ 99				-16.9% \ -22.0%		-25.5% \ -51.0%
CVaR 95 \ 99				-20.9% \ -30.5%		-40.6% \ -67.5%

WÄHRUNGSaufTEILUNG



LÄNDERaufTEILUNG



TOP KOMponentEN 18.06.2024

Unternehmen	Ticker	Land	Währung	Gewicht
AIRBUS SE	AIR SQ Equity	NL	EUR	15.11%
IBERDROLA SA	IBE SQ Equity	ES	EUR	13.20%
BANCO SANTANDER SA	SAN SQ Equity	ES	EUR	12.47%
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL SA	ITX SQ Equity	ES	EUR	10.37%
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	BBVA SQ Equity	ES	EUR	9.40%
AMADEUS IT GROUP SA CLASS A	AMS SQ Equity	ES	EUR	4.81%
CAIXABANK SA	CABK SQ Equity	ES	EUR	3.53%
TELEFONICA SA	TEF SQ Equity	ES	EUR	3.44%
FERROVIAL SE	FER SQ Equity	ES	EUR	3.12%
CELLNEX TELECOM SA	CLNX SQ Equity	ES	EUR	3.08%
REPSOL SA	REP SQ Equity	ES	EUR	3.02%
AENA SME SA	AENA SQ Equity	ES	EUR	2.37%
ARCELORMITTAL SA	MTS SQ Equity	LU	EUR	1.83%
BANCO DE SABADELL SA	SAB SQ Equity	ES	EUR	1.62%
ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS SA	ACS SQ Equity	ES	EUR	1.43%
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	IAG SQ Equity	ES	EUR	1.27%
RED ELECTRICA CORP SA	RED SQ Equity	ES	EUR	1.13%
ENDESA SA	ELE SQ Equity	ES	EUR	1.04%
BANKINTER SA	BKT SQ Equity	ES	EUR	0.86%
VIDRALA SA	VID SQ Equity	ES	EUR	0.62%
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	MRL SQ Equity	ES	EUR	0.59%
ENAGAS SA	ENG SQ Equity	ES	EUR	0.57%
GRIFOLS SA CLASS A	GRF SQ Equity	ES	EUR	0.47%
ACCIONA SA	ANA SQ Equity	ES	EUR	0.47%
INDRA SISTEMAS SA	IDR SQ Equity	ES	EUR	0.41%
VISCOFAN SA	VIS SQ Equity	ES	EUR	0.39%
MAPFRE SA	MAP SQ Equity	ES	EUR	0.35%
FLUIDRA SA	FDR SQ Equity	ES	EUR	0.32%
ACERINOX SA	ACX SQ Equity	ES	EUR	0.29%
LABORATORIOS FARMACEUTICOS R	ROVI SQ Equity	ES	EUR	0.29%
COMPANIA DE DISTRIBUCION INTEGRAL LOGISTA HOLDINGS SA	LOG SQ Equity	ES	EUR	0.27%
GRUPO CATALANA OCCIDENTE SA	GCO SQ Equity	ES	EUR	0.27%
SACYR SA	SCYR SQ Equity	ES	EUR	0.25%
UNICAJA BANCO SA	UNI SQ Equity	ES	EUR	0.25%
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	COL SQ Equity	ES	EUR	0.24%
APPLUS SERVICES SA	APPS SQ Equity	ES	EUR	0.20%
FAES FARMA SA	FAE SQ Equity	ES	EUR	0.19%
CIE AUTOMOTIVE SA	CIE SQ Equity	ES	EUR	0.19%
SOLARIA ENERGIA Y MEDIO AMBI	SLR SQ Equity	ES	EUR	0.14%
EBRO FOODS SA	EBRO SQ Equity	ES	EUR	0.14%

HINWEISE

© Solactive AG, 2024. Alle Rechte vorbehalten.

Alle in diesem Factsheet enthaltenen Informationen sind allgemeiner Natur, nicht auf die Bedürfnisse von einzelnen Personen, Unternehmen oder Personengruppen ausgerichtet und dienen ausschließlich Informationszwecken. Die Informationen stammen aus öffentlich zugänglichen Quellen, die als zuverlässig erachtet werden. Die Solactive AG gibt keine ausdrückliche oder stillschweigende Garantie oder Zusicherung ab, dass diese Informationen korrekt oder vollständig sind. Die Inhalte des Factsheets werden "wie vorliegend" bereitgestellt. Die Solactive AG übernimmt keine Verantwortung oder Haftung für Fehler oder Verluste durch die Verwendung dieses Factsheets oder der darin enthaltenen Informationen oder Daten. Die Solactive AG haftet nicht für direkte oder indirekte Schäden oder Folgeschäden im Zusammenhang mit der Verwendung des Factsheets und seines Inhalts, selbst wenn die Solactive AG über die Möglichkeit solcher Schäden informiert wurde.

Es ist nicht möglich, direkt in einen Index zu investieren. Ein Exposure im Hinblick auf Vermögenswerte, die durch einen Index abgebildet werden, ist mittels investierbarer Finanzinstrumente möglich, die darauf abzielen, eine Anlagerendite zu erzielen, die auf der Wertentwicklung eines Index basiert. Eine Entscheidung, in ein solches Finanzinstrument zu investieren, sollte nicht auf der Grundlage einer der in diesem Dokument dargelegten Aussagen getroffen werden. Potenzielle Anleger sollten erst nach sorgfältiger Abwägung der mit einer Anlage in solche Finanzinstrumente verbundenen Risiken eine Anlage tätigen. Solche Risiken sind beispielsweise in einem Emissionsprospekt oder einem ähnlichen Dokument beschrieben, das vom oder im Namen des Emittenten des Finanzinstruments erstellt wird.

Die Finanzinstrumente werden von der Solactive AG nicht gesponsert, gefördert, verkauft oder auf eine andere Art und Weise unterstützt und die Solactive AG bietet keinerlei ausdrückliche oder stillschweigende Garantie oder Zusicherung, weder hinsichtlich der Ergebnisse aus einer Nutzung des Index- und/oder der Index-Marke noch hinsichtlich des Indexstands zu irgendeinem bestimmten Zeitpunkt noch in sonstiger Hinsicht. Die Solactive AG gibt keine Zusicherung, dass Finanzinstrumente, in denen auf den Index Bezug genommen wird, die Wertentwicklung des Index genau abbilden oder eine positive Anlagerendite liefern. Die Solactive AG ist kein Anlageberater und nichts in diesem Factsheet stellt eine Empfehlung der Solactive AG dar, eine Anlage in Finanzinstrumente zu tätigen, noch stellt es in irgendeiner Weise eine Ansicht der Solactive AG in Bezug auf eine Anlage in ein Finanzinstrument dar. Die Aufnahme eines Wertpapiers in einen Index stellt weder eine Empfehlung der Solactive AG zum Kauf, Verkauf oder Halten eines solchen Wertpapiers dar, noch ist dies als Anlageberatung zu verstehen.

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit sollte nicht als Indikator oder Garantie für eine zukünftige Wertentwicklung angesehen werden. Die Diagramme und Grafiken werden ausschließlich zu Illustrationszwecken zur Verfügung gestellt.

Diese Information wird ausschließlich von der Solactive AG, Platz der Einheit 1, D-60327 Frankfurt am Main | E-Mail: indexing@solactive.com zur Verfügung gestellt.

"Solactive", "Solactive GBS", "German Index Engineering" und das Logo  sind eingetragene Marken der Solactive AG.

Die Informationen in diesem Dokument stellen keine Steuer-, Rechts- oder Anlageberatung dar. Das Factsheet und sein Inhalt dürfen ohne vorherige schriftliche Zustimmung der Solactive AG weder ganz noch teilweise verändert, reproduziert, weitergegeben oder gespeichert werden.