

Ethos Index on MSCI World*

Ein Ethos Aktienindex berechnet von MSCI



Factsheet - 31.05.2024

Das Wichtigste in Kürze

Dieser von MSCI auf Basis der Ethos-Daten berechnete Index wird zweimal jährlich neu balanciert. Er hat zum Ziel, Unternehmen, die in sensiblen Sektoren tätig sind oder deren Verhalten sehr umstritten ist (Prinzipien 2 und 3 der Ethos-Prinzipien für nachhaltige Anlagen) aus dem traditionellen Index MSCI World (MXWO) auszuschliessen.

Ausgeschlossen sind daher Unternehmen, die in folgenden Bereichen tätig sind: Waffen, Tabak, GVO in der Agrochemie, Nuklear- und Kohleindustrie, Pornographie, Fossile Energieträger unkonventionellen Ursprungs und Glücksspiel. Ausgeschlossen sind auch Unternehmen, deren Verhalten stark umstritten ist. Beispiele für ESG-Kontroversen:

- Umwelt: irreversible Umweltschäden,...
- Soziales: Kinderarbeit, Menschenrechtsverletzungen,...
- Governance: Finanzskandale,....

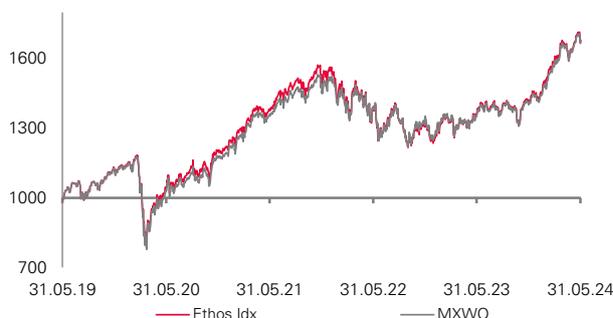
Andere wichtige Kontroversen, die sich ergeben können:

- Geschäftsethik: Korruption, Marktmanipulation,...
- Produkte: Kontroverse Waffen,...

Ohne Doppelausschlüsse zu zählen, machen die Unternehmen, welche nicht im Ethos Index on MSCI World enthalten sind, 11.1% des Ausgangsindex aus (MSCI World per 31.05.2024).

Performance-Vergleich in CHF

	Ethos Idx Kumuliert	MXWO Kumuliert	Ethos Idx Jahresdurchschnitt	MXWO Jahresdurchschnitt
1 Monat	2.90%	2.82%	-	-
3 Monate	5.77%	6.54%	-	-
YTD	17.09%	17.66%	-	-
3 Jahren	21.69%	23.52%	6.76%	7.30%
5 Jahren	68.00%	67.53%	10.93%	10.87%
Seit Auflegung (31.12.2015)	128.00%	126.42%	10.29%	10.20%



Die historische Performance stellt keinen Indikator für die zukünftige Performance dar.

Positionen und Aufteilung nach Sektoren

Top 10 Positionen

	Ethos Idx	MXWO	
MICROSOFT CORP	5.1%	4.5%	0.6%
APPLE	4.9%	4.3%	0.6%
NVIDIA	4.7%	4.2%	0.5%
AMAZON.COM	2.8%	2.5%	0.3%
META PLATFORMS A	1.8%	1.6%	0.2%
ALPHABET A	1.8%	1.6%	0.2%
ALPHABET C	1.6%	1.4%	0.2%
LILLY (ELI) & COMPANY	1.1%	1.0%	0.1%
BROADCOM	1.0%	0.9%	0.1%
BERKSHIRE HATHAWAY B	0.9%	0.8%	0.1%

Aufteilung nach Sektoren

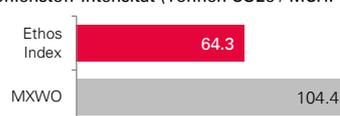
	Ethos Idx	MXWO	
Informationstechnologie	28.9%	26.0%	2.9%
Gesundheit	13.2%	11.8%	1.4%
Finanz	13.8%	13.6%	0.3%
Konsum, nichtzyklisch	11.1%	10.2%	0.9%
Industrie	9.0%	11.1%	-2.1%
Kommunikation	8.7%	7.7%	1.0%
Konsum, zyklisch	6.8%	6.6%	0.2%
Materialien	3.7%	3.9%	-0.1%
Immobilien	0.4%	0.3%	0.0%
Energie	1.3%	4.4%	-3.1%
Versorger	1.1%	2.6%	-1.5%
Total	100.0%	100.0%	

Kohlenstoff-Fussabdruck

Der Kohlenstoff-Fussabdruck umfasst:

- Scope 1 des GHG Protokolls: die direkten Emissionen verursacht durch die Produktion (z.B. Treibstoffverbrauch an den Firmenstandorten).
- Scope 2 des GHG Protokolls: die indirekten Emissionen der unmittlaren Energie-Lieferanten (z.B. Verbrauch von eingekaufter Elektrizität, Wärme oder Dampf).

Kohlenstoff-Intensität (Tonnen CO2e / MCHF Umsatz)



Quelle: Trucost - 31.03.2024

Ausschlüsse

Ausschluss wegen Produkten

	Anzahl Unterneh.	Gewicht im MXWO
Waffen	39	3.01%
Nichtkonv. Waffen	19	1.62%
Kohle	30	1.06%
Glücksspiel	18	0.38%
Nuklear	19	1.18%
GVO	3	0.15%
Pornographie	0	0.00%
Tabak	7	0.59%
unkonv. Fossile Energie	41	2.47%
Total (ohne Doppelausschlüsse)	149	8.57%

Ausschluss wegen Verhalten

	Anzahl Unterneh.	Gewicht im MXWO
Umwelt	24	2.27%
Geschäftsethik	3	1.74%
Governance	11	0.00%
Produkte	7	1.48%
Soziales	0	0.33%
Total (ohne Doppelausschlüsse)	42	4.96%

* A custom index calculated by MSCI based on the exclusion list provided by Ethos.

Ausschlusskategorien und Top 3 der ausgeschlossenen Unternehmen

Rüstung (konventionelle und nicht-konventionelle)

Die konventionelle Rüstung bezieht sich auf die Produktion von Waffen und von direkt damit verbundenen Zulieferungen, welche von militärischen Kampf- und Verteidigungsverbänden eingesetzt werden. Es handelt sich um konventionelle Waffen, die unter Einhaltung des internationalen Menschenrechts für Verteidigungszwecke eingesetzt werden können.

Die nichtkonventionelle Rüstung bezieht sich auf die Produktion von Waffen und Ausrüstungen, die in den wichtigsten internationalen Vereinbarungen verboten sind. Es handelt sich hauptsächlich um chemische, bakteriologische und nukleare Waffen sowie Streubomben.

Name	Gewicht im MXWO
GE AEROSPACE	0.28%
RTX	0.24%
HONEYWELL INTERNATIONAL	0.20%

Fossile Energieträger unkonventionellen Ursprungs

Der Ausschluss gilt für Unternehmen, die in der Gewinnung und Nutzung folgender unkonventioneller fossiler Energieträger tätig sind: Erdöl aus Ölsand, Schieferöl und -gas sowie Öl und Gas aus der Arktis. Aufgrund ihrer Schlüsselrolle bei der Entwicklung dieser Tätigkeiten schliesst Ethos auch die Unternehmen aus, die am Transport solcher Energieträger in Öl- und Gaspipelines beteiligt sind.

Name	Gewicht im MXWO
CHEVRON CORP	0.45%
CONOCOPHILLIPS	0.21%
CANADIAN NAT RESOURCES	0.13%

Kohle

Das Kriterium der Kohle bezieht sich auf den Abbau von Kohle oder die Erzeugung von Elektrizität mittels Kohle.

Name	Gewicht im MXWO
SOUTHERN COMPANY (THE)	0.13%
DUKE ENERGY CORP	0.12%
GLENORE	0.10%

Glücksspiele

Das Kriterium Glücksspiele bezieht sich auf den Betrieb von Casinos, Rennplätzen und die Herstellung von Geldspielautomaten sowie auf Unternehmen, die innerhalb von Casinos Darlehen gewähren.

Name	Gewicht im MXWO
ROYAL CARIBBEAN GROUP	0.06%
FLUTTER ENTERTAINMENT	0.05%
VICI PROPERTIES	0.05%

Kernenergie

Der Sektor der Kernenergie bezieht sich auf die Erzeugung von Kernenergie, den Bau von Kernreaktoren, die Lagerung und Aufbereitung von radioaktiven Abfällen sowie auf die Versorgung mit Nuklearenbrennstoffen oder Uranium.

Name	Gewicht im MXWO
NEXTERA ENERGY	0.25%
SOUTHERN COMPANY (THE)	0.13%
DUKE ENERGY CORP	0.12%

Gentechnisch veränderte Organismen (GVO) in der Agrochemie

Das Kriterium der GVO bezieht sich auf agrochemische Aktivitäten. Betroffen sind Unternehmen, die GVO durch Entwicklung und Produktion transgener Saatguts oder gegebenenfalls damit zusammenhängenden Erzeugnissen aktiv fördern. Der medizinische Bereich ist von diesem Ausschluss ausgenommen.

Name	Gewicht im MXWO
CORTEVA	0.06%
BAYER	0.05%
NUTRIEN	0.04%

Pornografie

Das Kriterium der Pornografie bezieht sich auf die Herstellung von erniedrigenden Darstellungen sexueller Akte, die die Menschenwürde verletzen, sowie auf die aktive Verbreitung derartigen Materials über verschiedene Kanäle wie die Medien, den Handel oder das Internet.

Kein Unternehmen im Referenzuniversum

Tabak

Das Kriterium Tabak bezieht sich auf Aktivitäten in der Produktion von Zigaretten, Zigarren und Pfeifentabak sowie auf Unternehmen, deren Haupttätigkeit der Tabakhandel und/oder der Engrosvertrieb von Rohtabak an die Zigarettenindustrie oder eine vergleichbare Aktivität ist.

Name	Gewicht im MXWO
PHILIP MORRIS INTL	0.24%
ALTRIA GROUP	0.13%
BRITISH AMERICAN TOBACCO	0.10%

Ausschlusses aufgrund des Verhaltens der Unternehmen

Ausschlüsse aufgrund des Verhaltens von Unternehmen werden beschlossen, wenn diese in schwerwiegende Kontroversen in Fragen der Corporate Governance oder der Umwelt- und Sozialverantwortung verwickelt sind.

Name	Gewicht im MXWO
JPMORGAN CHASE & CO	0.90%
EXXON MOBIL CORP	0.81%
CHEVRON CORP	0.45%

Ethos Services SA

1 Place de Pont-Rouge, Postfach, CH-1211 Genf 26 - T +41 22 716 15 55 - F +41 22 716 15 56
Büro Zürich: Glockengasse 18, CH-8001 Zürich - T +41 44 421 41 11 - F +41 44 421 41 12
www.ethosfund.ch - info@ethosfund.ch

Disclaimer

Diese Marketing-Unterlage wird von Ethos Services SA herausgegeben. Sie ist nicht für die Verteilung an oder die Verwendung durch Personen oder Einheiten bestimmt, die die Staatsangehörigkeit oder den Wohn- oder Geschäftssitz in einem Ort, Staat, Land oder Gerichtskreis haben, in denen eine solche Verteilung, Veröffentlichung, Bereitstellung oder Verwendung gegen Gesetze oder andere Bestimmungen verstösst. Als offizielle Fondspublikationen, die als Grundlage für Anlageentscheidungen dienen, gelten nur die jeweils zuletzt veröffentlichten Fassungen des Verkaufsprospekts, des Reglements, des Jahres- und Halbjahresberichts. Diese Dokumente werden auf der Website www.ethosfund.ch und bei allen der oben genannten Büros von Ethos zur Verfügung gehalten. Die im vorliegenden Dokument enthaltenen Informationen und Daten stellen in keinem Fall ein Kauf- oder Verkaufsangebot oder eine Aufforderung zur Zeichnung von Wertpapieren oder Finanzinstrumenten dar. Im Übrigen spiegeln die hier wiedergegebenen Informationen, Meinungen und Schätzungen eine Beurteilung zum Veröffentlichungsdatum wider und können ohne besondere Benachrichtigung geändert werden. Ethos Services SA bietet keinerlei Gewähr, dass die in dieser Marketing-Unterlage erwähnten Wertpapiere sich für einen bestimmten Investor eignen. Diese Unterlage kann nicht als Ersatz einer unabhängigen Beurteilung dienen. Der Wert und die Erträge der in dieser Unterlage erwähnten Wertpapiere und Finanzinstrumente können sinken oder steigen. Folglich laufen Anleger die Gefahr, dass sie weniger zurück erhalten, als sie ursprünglich investiert haben. Risikofaktoren werden im Fondsprospekt aufgeführt und in dieser Unterlage nicht vollständig wiedergegeben. In der Vergangenheit erzielte Resultate geben keine zuverlässigen Anhaltspunkte über die zukünftige Entwicklung. Bei der Zeichnung oder Rücknahme belastete Provisionen/Kommissionen und Gebühren sind nicht in der Performance enthalten. Diese Marketing-Unterlagen sind kein Ersatz für die vollständigen Fondsunterlagen und Informationen, die Investoren von ihren Vermittlern für Anlagen im in dieser Unterlage erwähnten Fonds erhalten müssen. Wird das Portfoliovermögen in Anlagen anderer Währungen platziert, bestehen Fremdwährungsrisiken.

Signatory of:
 Principles for Responsible Investment
PRI Montréal PLEDGE