

ETF-TopFonds Liste

Die passenden ETFs für Ihren Bedarf

Stand: 31.01.2023

Fondsname	WKN	SRRI	Replikation	Performance in %				Risiko in %				Sharpe Ratio			ESG-Risiken					Kommentar
				2023	1 J.	3 J.	5 J.	Volatilität			Max. Verlust*	1 J.	3 J.	5 J.	MS Globen	E	S	G	SFDR Artikel	
								1 J.	3 J.	5 J.										

AKTIENFONDS

Aktienfonds Welt

Welt

iShares MSCI World Small Cap ETF USD Acc	A2DWBY	6	R	7,4	-0,7	25,3		21,8	22,5		-27,3	-0,3	0,1		2	3,3	5,0	3,9	6	
iShares MSCI World SRI ETF EUR Acc	A2DVB9	6	R	6,5	-4,9	32,1	70,2	21,7	19,0	4,8	-16,8	-0,5	0,1	0,1	4	3,8	8,5	6,5	8	
First Trust Gbl Cap. Strength ESG Leaders	A2QMAA	6		0,9	-3,8			16,0			-7,4	-0,6			4	3,6	9,1	7,1	8	

Europa

iShares MSCI Europe SRI ETF EUR Acc	A1H7ZS	6	R		-3,5						0,0				5	3,6	7,6	6,3	8	
iShares STOXX Europe Mid 200 (DE)	593399	6	R	8,7	-7,5	7,2	17,2	23,3	22,6	5,5	-46,9	-0,6	0,0	0,0	4	4,9	7,6	6,3	6	
iShares STOXX Europe Small 200 (DE)	A0D8QZ	6	R	7,0	-12,1	6,8	15,6	25,2	23,5	5,7	-48,4	-0,7	0,0	0,0	4	4,8	8,0	6,7	6	
Xtrackers MSCI Nordic ETF 1D	A1T791	4	R	1,9	-2,5	34,8	51,9	22,1	19,5	4,8	-21,6	-0,4	0,1	0,1	2	4,3	8,7	7,3	6	
Xtrackers Switzerland ETF 1D	DBX1SM	6	R	4,1	-2,2	17,3	32,8	14,3	14,3	3,7	-31,6	-0,6	0,1	0,1	2	4,7	9,1	7,2	6	

USA

iShares MSCI USA ESG Scrn ETF USD Acc	A2N6TB	6	R	5,2	-7,1	34,5		22,2	20,1		-18,9	-0,6	0,1		4	3,6	9,6	7,5	8	
iShares MSCI USA Small Cap ETF USD Acc	A0X8SB	7	R	8,6	3,1	35,2	42,4	23,9	24,6	6,3	-29,8	-0,1	0,1	0,1	4	2,4	4,2	3,1	8	
First Trust US Large Cap Core AlphaDEX®	A1T860	6	R	4,6	2,2	39,7	45,3	21,4	21,3	5,5	-25,0	-0,2	0,2	0,1	2	6,9	9,4	6,9	6	
Lyxor Nasdaq 100 ETF Acc	LYX00F	6	S	8,7	-15,8	39,6	105,6	28,0	23,2	6,0	-34,6	-0,8	0,1	0,2					6	

Deutschland

Lyxor 1 DAX 50 ESG (DR) ETF I	ETF909	6	R	10,3	-4,7			24,5			-25,6	-0,4			3	4,6	7,7	7,0	8	
Xtrackers Germany Mittelstand & MidCap	A1T795	5	R	14,4	-11,6	12,6	5,4	29,5	24,8	6,2	-36,7	-0,6	0,1	0,0	3	4,9	8,8	6,5	8	

Fondsname	WKN	SRRI	Replikation	Performance in %				Risiko in %				Sharpe Ratio			ESG-Risiken					Kommentar
				2023	1 J.	3 J.	5 J.	Volatilität			Max. Verlust*	1 J.	3 J.	5 J.	MS Globen	E	S	G	SFDR Artikel	
								1 J.	3 J.	5 J.										

Schwellenländer

Amundi IS MSCI Em Asia ETF-C EUR	A2H58R	6	S	6,7	-8,5	10,6	9,7	22,0	17,8	4,7	-28,2	-0,7	0,0	0,0						6		
Amundi IS MSCI Em Latin America ETF-C €	A2H58P	7	S	8,0	14,9	1,1	2,8	29,5	32,9	8,1	-44,5	0,3	0,0	0,0	3						6	
Franklin FTSE India UCITS ETF	A2PB5W	6	R	-3,9	-5,7	30,0		19,3	23,4		-29,6	-0,6	0,1		4	7,5	8,5	7,3			6	
iShares MSCI Eastern Eurp Cp ETF USD Dis	A0HGWB	6	R								0,0				4						6	
iShares MSCI EM Small Cap ETF USD Dist	A0RGER	6	R	4,1	-5,4	28,8	3,4	16,9	21,6	5,3	-33,5	-0,7	0,1	0,0	1	0,7	1,2	1,1			6	
iShares MSCI EM SRI ETF USD Acc	A2AFCZ	6	R	5,1	-7,2	9,3	-1,3	18,3	20,2	4,9	-26,6	-0,7	0,0	0,0	4	4,8	9,1	8,2			8	
SPDR® S&P Pan Asia Div Aristocrats ETF	A1T8GC	6	R	3,9	-6,1	-3,9	-2,6	18,9	17,4	4,3	-21,7	-0,6	0,0	0,0	4	5,1	7,9	7,7			6	
Xtrackers CSI300 Swap ETF 1C	DBX0M2	6	S	8,8	-7,2	29,3	21,1	24,3	19,2	5,6	-43,2	-0,5	0,1	0,1							6	
Xtrackers MSCI Africa Top 50 Swap ETF 1C	DBX0HX	6	S	-0,3	-11,0	-8,2	-26,5	19,8	22,6	5,7	-44,7	-0,9	0,0	-0,1							6	
Xtrackers S&P Select Frontier Swap ETF 1C	DBX1A9	4	S	10,7	0,5	15,6	-1,2	22,2	24,6	6,3	-63,5	-0,2	0,1	0,0							6	

Weitere Länder

iShares MSCI Japan SRI ETF	A2AUE9	6	R	4,4	-4,7	4,4	5,6	16,9	15,6	4,2	-17,5	-0,6	0,0	0,0	5	4,6	8,7	8,1			8	
Lyxor Australia (S&P/ASX 200) ETF D EUR	LYX0FU	6	S	8,4	15,2	25,7	45,8	26,0	26,3	6,2	-32,5	0,4	0,1	0,1							6	
UBS(Lux)FS MSCI Pacific SRI USD Adis	A1JA1U	6	R	5,1	-4,0	4,4	5,4	18,6	16,3	4,2	-17,0	-0,5	0,0	0,0	5	4,3	8,4	7,3			8	

Aktienfonds Branchen und Themen

Amundi IS Smart Factory ETF-D EUR	A2PN78	6	S	9,7	-13,3	11,0		21,3	21,4		-30,7	-0,9	0,1								6	
BNPP E ECPI Global ESG Infrass ETF	A2ACQY	6	R	5,4	-3,7	0,5	32,8	18,1	18,9	4,7	-24,7	-0,5	0,0	0,0	4	5,8	8,2	5,9			8	
BNPP E. FTSE EPRA Nareit Dev. Eur. ex UK Green E	A2PP8E	6	R	8,4	-32,4	-36,2		33,4	27,2		-46,6	-1,1	-0,1		5	2,4	3,3	4,8			8	
Invesco CoinShares Global Blockchain ETF	A2PA3S	7	R	15,6	-31,8	41,2		33,4	38,1		-53,7	-1,1	0,1		2	2,5	7,8	7,2			6	
iShares Ageing Population ETF USD Acc	A2ANH1	6	R	4,8	1,4	14,5	6,5	15,5	19,0	4,9	-25,8	-0,3	0,1	0,0	2	1,5	8,6	6,4			8	
iShares Asia Property Yield ETF USD Dist	A0LEQL	7	R		-6,3						0,0				2	3,0	2,9	5,9			6	
iShares Automation&Robotics ETF USD Acc	A2ANH0	7	R	10,2	-11,5	29,1	27,0	27,6	24,7	6,6	-31,8	-0,6	0,1	0,1	2	3,5	6,7	4,9			8	
iShares EM Infrastructure ETF USD Dist	A0NECV	6	R		-3,4						0,0				2	8,9	9,0	6,7			6	
iShares Global Timber&Forestry ETF \$ Dis	A0M59G	7	R		-9,9						0,0				5	9,0	2,8	4,1			8	

Fondsname	WKN	SRRI	Replikation	Performance in %				Risiko in %				Sharpe Ratio			ESG-Risiken					Kommentar
				2023	1 J.	3 J.	5 J.	Volatilität			Max. Verlust*	1 J.	3 J.	5 J.	MS Globen	E	S	G	SFDR Artikel	
								1 J.	3 J.	5 J.										
iShares Gold Producers ETF USD Acc	A1JKQJ	7	R	9,7	8,4	13,2	40,3	30,7	35,1	8,9	-57,9	0,1	0,1	0,1	4	9,7	8,5	5,5	6	
iShares Nasdaq US Biotech ETF USD Acc	A2DWAU	6	R	1,7	8,4	25,5	22,8	16,0	18,7	5,8	-23,3	0,2	0,1	0,1	2	1,1	11,3	5,9	6	
iShares STOXX Eurp 600 Pers. & H. Goods	A0H08N	6	R	9,7	2,1	23,7	40,8	22,5	19,1	4,8	-35,6	-0,2	0,1	0,1	5	3,4	7,7	6,3	6	
iShares US Property Yield ETF USD Dist	A0LEW6	7	R		-12,7						0,0				3	3,6	3,3	4,8	6	
L&G Battery Value-Chain ETF	A2H5GK	7	R	11,6	5,5	103,5	83,2	27,7	26,1	6,5	-21,3	0,0	0,3	0,2	2	6,9	8,1	7,5	8	
L&G Clean Energy ETF USD Acc	A2QFEN	6	R	4,1	10,1			26,6			-16,8	0,2			4	5,1	6,9	4,9	9	
L&G Clean Water ETF	A2PM52	6	R	7,0	1,1	38,6		23,3	20,6		-20,4	-0,2	0,2		2	4,8	5,0	3,6	9	
L&G Digital Payments ETF	A2H5GM	7	R	11,7	-11,2			25,5			-22,2	-0,7			2	1,0	6,4	4,6	8	
L&G Ecommerce Logistics ETF	A2H5GL	6	R	9,1	-3,8	57,1	49,0	23,9	20,1	5,5	-25,1	-0,4	0,2	0,1	3	3,7	8,1	6,0	8	
L&G Healthcare Breakthrough ETF	A2PM51	6	R	5,6	-14,0	20,4		21,3	22,6		-33,9	-0,9	0,1		3	1,7	8,2	5,6	9	
Lyxor MSCI Digital Economy ESG ETF Acc	LYX0ZH	7	R	11,1	-18,2			23,8			-38,7	-1,0			3	2,1	9,2	6,9	8	
Lyxor MSCI Future Mobility ESG ETF Acc	LYX0ZJ	7	R	16,5	-12,1			34,3			-35,1	-0,5			3	5,2	6,9	6,2	8	
Lyxor MSCI Smart Cities ESG Fund	LYX0ZK	6	R	9,3	-5,5			22,4			-20,8	-0,5			4	4,7	6,0	4,8	8	
Lyxor MSCI World Consumer Discr. ETF EUR	LYX0GH	6	S	12,6	-14,2	25,2	54,4	30,5	25,5	6,2	-29,6	-0,7	0,1	0,1					6	
Lyxor MSCI World HealthCare TR ETF C EUR	LYX0GM	6	S	-2,4	4,4	31,1	73,5	13,9	14,7	4,0	-16,2	-0,1	0,2	0,2					6	
Lyxor MSCI World Info Tech TR ETF C EUR	LYX0GP	6	S	8,1	-14,4	38,9	114,3	28,7	23,8	6,2	-26,5	-0,7	0,1	0,2					6	
Lyxor MSCI World Materials TR ETF C EUR	LYX0GQ	6	S	8,6	6,5	48,4	53,7	23,9	21,0	5,4	-27,2	0,0	0,2	0,1					6	
Lyxor STOXX Euro 600 Auto & Prt ETF Dis	LYX04B	7	S	11,3	-7,3			29,1			-25,9	-0,5							6	
Lyxor Stoxx Europe 600 Food & Beverage	LYX02J	6	S	1,8	-6,0	3,0	25,9	16,0	16,7	4,2	-31,4	-0,7	0,0	0,0					6	
Lyxor STOXX Europe 600 Telecommunications	LYX04R	6	S	7,3	-11,4			18,1			-19,2	-1,0							6	
Lyxor STOXX Europe 600 Travel & Leisure	LYX02U	7	S	14,8	-0,8	-8,5		32,0	35,7		-37,9	-0,2	0,0						6	
Rize Cybersecurity Data Privacy ETF	A2PX6V	6	R	4,7	-15,9			23,4			-30,9	-0,9			3	2,1	6,5	4,0	8	
Rize Medical Cannabis & Life Sciences ETF	A2PX6U	7	R	8,4	-35,8			29,7			-67,0	-1,4			1	3,4	11,8	7,5	8	
Rize Sustainable Future of Food ETF USD	A2P876	6	R	6,7	-10,4			22,9			-29,1	-0,7			3	7,7	5,4	4,5	9	
VanEck Vectors Semiconductor ETF	A2QC5J	7	R	14,4	-12,5			40,8			-32,5	-0,4			5	5,9	5,3	6,2	8	
VanEck Vectors™ Video Gaming & Sports	A2PLDF	6	R	11,4	-17,1	35,1		26,2	21,4		-35,0	-0,9	0,1		4	1,4	8,8	7,1	8	
WisdomTree Artificial Intelligence ETF USD	A2N7KX	6	R	16,0	-20,6	38,6		30,7	29,7		-37,8	-0,9	0,1		3	3,5	6,2	5,3	8	
WisdomTree Cloud Computing ETF USD Acc	A2PQVE	7	R	12,6	-33,8	4,3		27,4	31,9		-56,6	-1,4	0,0		3	1,6	6,3	4,2	8	
Xtrackers LPX Private Equity Swap ETF 1C	DBX1AN	7	S	11,1	-16,5	22,6	57,5	37,1	32,4	7,8	-72,2	-0,6	0,1	0,1					6	

Fondsname	WKN	SRRI	Replikation	Performance in %				Risiko in %				Sharpe Ratio			ESG-Risiken					Kommentar
				2023	1 J.	3 J.	5 J.	Volatilität			Max. Verlust*	1 J.	3 J.	5 J.	MS Globen	E	S	G	SFDR Artikel	
								1 J.	3 J.	5 J.										
Xtrackers MSCI Wld Consumer Stp ETF 1C	A113FG	5	R	-0,7	1,0	18,2	25,7	14,9	13,9	3,6	-12,4	-0,3	0,1	0,1	3	7,3	9,8	6,0	6	
Xtrackers MSCI World Energy ETF 1C	A113FF	7	R	1,3	34,9	64,0	33,5	30,9	37,0	9,1	-55,7	0,9	0,2	0,1	2	17,0	8,9	7,4	6	
Xtrackers MSCI World Financials ETF 1C	A113FE	5	R	6,9	0,3	27,1	19,1	19,8	23,2	5,9	-30,3	-0,3	0,1	0,1	4	1,3	9,7	10,2	6	
Xtrackers MSCI World Industrials ETF 1C	A113FN	6	R	3,9	1,7	22,8	23,4	22,0	21,5	5,6	-25,1	-0,2	0,1	0,1	3	6,8	10,3	6,6	6	
Xtrackers MSCI World Utilities ETF 1C	A113FJ	4	R	-1,5	2,0	6,7	39,9	16,3	16,3	4,0	-17,6	-0,2	0,0	0,1	4	11,6	9,0	5,7	6	

Aktienfonds Faktoren

Deka STOXX® Europe Strong Growth 20 ETF	ETFL03	6	R	6,7	-17,2	4,4	42,6	30,6	27,6	6,9	-42,4	-0,8	0,0	0,1	2	3,5	9,7	7,0	6	
Deka STOXX® Europe Strong Value 20 ETF	ETFL04	6	R	17,6	-5,9	17,8	24,3	30,8	33,3	7,7	-34,2	-0,4	0,1	0,0	1	5,0	6,9	5,6	6	
iShares Edge MSCI Eurp Min Vola. ESG €Acc	A2PYV3	6	R	5,5	-4,9			17,0			-18,9	-0,6			4	4,4	7,6	6,1	8	
iShares Edge MSCI USA Min Vola ESG \$Acc	A2PY8D	6	R	1,2	0,3			17,1			-8,9	-0,3			5	4,1	8,5	6,1	8	
iShares Edge MSCI USA Momentum Factor ETF	A2AP36	6	R	-2,4	-7,3	16,8	36,9	20,4	19,4	5,0	-19,8	-0,6	0,1	0,1	1	7,1	10,9	7,3	6	
iShares Edge MSCI Wld Multifactor \$ Acc	A14YPA	6	R	4,7	-1,0	24,5	22,9	20,9	18,7	4,8	-20,9	-0,3	0,1	0,1	3	6,0	8,9	6,8	6	
iShares Edge MSCI World Min Vola. ESG \$Acc	A2PY8C	6	R	0,9	-0,2			13,6			-7,6	-0,4			4	4,1	8,6	6,5	8	
SPDR® S&P Euro Dividend Aristocrats ETF	A1JT1B	6	R	7,0	-1,5	-2,6	7,2	18,9	20,8	5,0	-27,4	-0,4	0,0	0,0	3	6,2	7,4	6,4	6	
SPDR® S&P Global Div Aristocrats ETF	A1T8GD	6	R	3,3	0,4	6,4	8,7	13,1	20,2	4,8	-30,7	-0,4	0,0	0,0	1	4,8	6,6	5,6	6	
SPDR® S&P US Dividend Aristocrats ETFDis	A1JKS0	6	R	1,6	8,1	35,8	50,8	18,6	18,7	4,7	-23,4	0,1	0,2	0,1	2	6,1	8,1	6,0	6	
UBS ETF Fact MSCI USA Prime Value USD A	A14XL9	6	R	4,8	4,2	43,4	53,0	19,0	19,5	5,1	-23,0	-0,1	0,2	0,1	4	4,0	10,4	7,4	6	
WisdomTree Glbl Eqly Div Gr ETF USD Acc	A2AG1E	5	R	3,0	-1,4	28,9	45,9	18,9	16,8	4,4	-16,8	-0,4	0,1	0,1	3	4,1	8,7	6,5	8	
Xtrackers MSCI World Momentum ETF 1C	A1103G	6	R	-0,7	-7,1	20,9	40,0	18,0	16,9	4,5	-16,1	-0,7	0,1	0,1	1	7,4	10,5	7,5	6	
Xtrackers MSCI World Quality ETF 1C	A1103D	6	R	4,2	-5,0	24,5	41,4	20,1	18,5	4,7	-17,8	-0,5	0,1	0,1	3	4,8	8,9	7,2	6	
Xtrackers MSCI World Value ETF 1C	A1103E	6	R	5,2	-0,3	17,7	8,4	17,7	19,6	5,0	-25,1	-0,3	0,1	0,0	2	5,6	9,6	7,8	6	

Aktien Sonstige

Amundi ETF Short MSCI USA Daily	A0X9PC	6	S	-4,5	-0,2	-42,6	-61,0	21,5	18,2	4,8	-86,2	-0,3	-0,3	-0,4						6	
Lyxor ShortDAX® TR ETF	ETF004	6	S	-7,8	-3,0	-30,7	-34,5	23,2	22,0	5,5	-68,6	-0,4	-0,2	-0,2						6	

Fondsname	WKN	SRRI	Replikation	Performance in %				Risiko in %				Sharpe Ratio			ESG-Risiken					Kommentar
				2023	1 J.	3 J.	5 J.	Volatilität			Max. Verlust*	1 J.	3 J.	5 J.	MS Globen	E	S	G	SFDR Artikel	
								1 J.	3 J.	5 J.										

Geldmarkt

iShares \$ Ultrashort Bond ETF USD Dist	A1W374	2	R	-1,2	5,2	5,2	8,7	9,1	7,6	1,9	-9,4	-0,1	0,0	0,0	3	3,5	9,6	7,8	6	
Lyxor Smart Cash ETF C EUR	LYX0WM	1		0,2	0,3	-0,6	-1,3	0,3	0,2	0,0	-1,9	-21	-3,3	-9,3					6	

Fondsname	WKN	SRRI	Replikation	Performance in %				Risiko in %				Sharpe Ratio			ESG-Risiken					Kommentar
				2023	1 J.	3 J.	5 J.	Volatilität			Max. Verlust*	1 J.	3 J.	5 J.	MS Globen	E	S	G	SFDR Artikel	
								1 J.	3 J.	5 J.										

Hinweis:

In unserer TopFonds Liste selektieren wir bei einem Fonds die Anlageklasse mit dem längsten Track Record. Wenn möglich empfehlen wir die EUR-Anteilsklasse. Einerseits notiert der Fonds dann bereits in unserer "Heimatwährung", andererseits erheben die Depotbanken bei Kauf und Verkauf von Nicht-EUR-Anteilsklassen sog. Währungsumrechnungsgebühren. Diese betragen bei den gängigen Plattformen 0,5 – 0,6%, also eine erhebliche zusätzliche Kostenbelastung! Währungsgesicherte Anteilsklassen wählen wir nur aus, wenn wir der Überzeugung sind, dass diese Anteilsklasse für die jeweilige Strategie am sinnvollsten ist. In den meisten Fällen empfehlen wir keine währungsgesicherten Tranchen, da oft nicht klar ist wie die Währungssicherung erfolgt oder wir die Sicherung als unsinnig oder teuer ansehen. Wir empfehlen, eigenständig nach der zu den individuellen Wünsche passenden Anteilsklasse zu suchen.

Alle Berechnungen erfolgen auf EUR-Basis. Datenquelle für alle Berechnungen: Morningstar. Replikationsmethode: R: Replizierender ETF; S: Synthetisch, SWAP basiert

Fonds unserer Premium Partner, die im Kalenderjahr auch auf Veranstaltungen präsentiert werden. Diese Fonds können, müssen aber nicht allen unseren Kriterien genügen.

Fonds die nach unseren Kriterien als nachhaltig einzustufen sind. (Kriterien siehe unten)

SFDR Klassifizierung:

Anforderung an Finanzinstitute, ihre Produkte in Nachhaltigkeitskategorien einzustufen. Grundsätzlich wird in drei Stufen unterschieden:

Artikel 6: Fonds berücksichtigt KEINE (oder in nur geringem Umfang) Nachhaltigkeitskriterien.

Artikel 8: Bewertung ökologischer oder sozialer Merkmale (oder beides).

Artikel 9: Fonds verfolgt nachhaltige Investitionen (mit explizitem Nachhaltigkeitsziel).

Die Einteilung eines Fonds erfolgt durch die Fondsgesellschaft selbst.

Die Nachhaltigkeitsbewertung von Morningstar wird anhand einer Skala von 1 (ein Globus - schwach) bis 5 (fünf Globen - sehr stark) ausgewiesen. Die Bewertung der Nachhaltigkeitsrisiken erfolgt auf Staats- und Unternehmensebene. Je nachdem wie ein Fonds positioniert ist, erfolgt eine Bewertung in einem oder in beiden Bereichen. Dabei gilt: Je niedriger der ausgewiesene Wert, desto geringer die Risiken.

Die einzelnen Scores (E, S und G) zeigen das Nachhaltigkeitsrisiko im jeweiligen Bereich.

Bitte beachten Sie hierbei, dass diese Nachhaltigkeitsbewertung ausschließlich nach quantitativen Kriterien durchgeführt wird und sich nicht mit unserer Einschätzung decken muss.

Wie sind die Werte zu interpretieren?

- Die Globen werden in der jeweiligen Kategorie anhand der Scores vergeben. Die 20% der Fonds mit dem niedrigsten Score erhalten einen Globus. Die 20% der Fonds mit dem höchsten Score erhalten fünf Globen.
- Die Vergabe erfolgt also RELATIV innerhalb einer Kategorie. Damit sind Fonds unterschiedlicher Kategorien in puncto Nachhaltigkeit nicht direkt miteinander vergleichbar.
- Basis für die Berechnung des Gesamtscores (und damit für die Vergabe der Globen) sind die drei Sub-Parameter E (Environmental), S (Social) und G (Governance). Für jeden Parameter vergibt Morningstar einen Score. Dabei gilt: Je niedriger der Wert, desto besser schneidet der jeweilige Fonds dort ab. Grund: Der Wert zeigt das Risiko an, den der Fonds aufweist. Je höher das Risiko desto höher der Score.
- Die Summe der einzelnen Scores (E, S und G) ergibt den Gesamtscore, aus dem dann die Anzahl der Globen ermittelt wird.

Alle Bewertungen werden von Morningstar und Sustainalytics durchgeführt.

Fondsname	WKN	SRRI	Replikation	Performance in %				Risiko in %				Sharpe Ratio			ESG-Risiken					Kommentar
				2023	1 J.	3 J.	5 J.	Volatilität			Max. Verlust*	1 J.	3 J.	5 J.	MS Globen	E	S	G	SFDR Artikel	
								1 J.	3 J.	5 J.										

Darüber hinaus bewertet auch die Bank für Vermögen die Fonds in diesem Bereich. Fonds die folgende Kriterien nachweisen, sind grün markiert. Für die Einstufung werden folgende Kriterien angesetzt.

1. Es muss ein Nachhaltigkeitsrating von Morningstar von mindestens vier Globen vorliegen.
2. Die relevante Ratinghistorie muss mindestens zwölf Monate betragen.
3. Stabilität: Über einen Zeitraum von mindestens sechs Monaten muss in mindestens einem der Einzelparameter E, S oder G ein unterdurchschnittlicher Risikoscore vorliegen.
4. Es sollte ein Commitment der Fondsgesellschaft zum Thema Nachhaltigkeit geben (entweder auf Unternehmensebene oder auf Ebene der Strategie).

Alle Daten erhalten wir von Morningstar (Systainalytics). Daher kann es insbesondere in Punkt vier vorkommen, dass entsprechende Daten und Aussagen noch nicht vorliegen.

Fonds die nach SFDR Artikel 6 klassifiziert sind, erhalten keine Nachhaltigkeitseinstufung durch die Bank für Vermögen. Fonds nach Artikel 9 werden hier automatisch eingestuft.

Maximum Draw Down (MDD):

Der MDD stellt den in der Historie erzielten maximalen Verlust eines Fonds während einer Verlustphase dar. Betrachtet wird eine Historie von 20 Jahren. Die Daten werden auf Wochenbasis von Morningstar berechnet.

Sharpe Ratio:

Die Sharpe Ratio ist eine Kennzahl, die die erzielte Überschussrendite (d.h. die über den risikolosen Zinssatz hinausgehende Rendite) eines Fonds ins Verhältnis zu seiner Volatilität setzt. Je höher die Sharpe Ratio ist, desto besser hat sich der Fonds im Verhältnis zu seinem Risikopotenzial entwickelt.

(Quelle: www.fondsweb.de)