



Michael Tschas - Finance & Ethics Research Team

Finance & Ethics Research

1. Folie

Mein Name ist Michael Tschas und ich möchte Ihnen heute die Produkte der Finance&Ethics Research Abteilung näher erläutern.

2. Folie

Finance & Ethics Research wurde 2004 von software-systems.at gegründet um globale Zusammenhänge in ein hochwertiges Finanzdaten-Research einfließen zu lassen.

Die Produktpalette der Finance & Ethics Research Abteilung reicht von FER Reports, der Miza - dem Programm zu Messung von Mittelzu und Abflüssen über DF4PB - umfangreiche Durchrechnung und Auswertung von Portfolios und Depots und der EDA und dem EDA Screening.

3. Folie

Die wöchentlichen Newsletter von uns bieten Ihnen einen Überblick über die globalen Marktentwicklungen eines beobachteten Veranlagungskapitals von 2 Billionen Euro. Insgesamt werden im Wochenrhythmus 6 Reports veröffentlicht.

Das sind der Nachhaltigkeitsreport mit Schwerpunkt ökologische und ethische Investments, der Gesamtmarktreport mit dem Gesamtüberblick, der Anleihenreport mit Bonität und Laufzeitenanalysen, der Schwellenländerreport, der Immobilien Report und der Alternative Investment Report mit Vergleichen der verschiedenen Alternative Investment Strategien.

Ich möchte Ihnen auf den weiteren Folien einige Highlight aus unseren Reports zeigen.

4. Folie

Der FER Style Transparency

zeigt das durchschnittliche KGV und die Marktkapitalisierung eines Fonds an. Hier sehen Sie zum Beispiel dass sich das durchschnittliche KGV dieser untersuchten Nachhaltigkeitsfonds zwischen 10 und 20 befindet und die Marktkapitalisierung im Bereich der Large Caps liegt.

5. Folie

Das FER SRI AG Ratio

sollte als Orientierung dienen und einen Überblick geben welche AG'S in Nachhaltigkeitsfonds besondere Berücksichtigung finden.

Hier sehen Sie zum Beispiel, dass die AG Vestas Wind Systems überdurchschnittliche oft von nachhaltigen Fonds gekauft wurde und deshalb eine FER SRI Ratio von 91 hat.

6. Folie

Außerdem wird der EDA zu allen Top Aktienfonds berechnet und in den Reports veröffentlicht. Rechts außen sehen Sie das Ergebnis der EDA Berechnung im letzten Nachhaltigkeitsreport.

Der ESPA Nachhaltigkeitsfonds erreichte wie Sie sehen eine EDA von 87 das heißt dass dieser Fonds den individuellen Vorgabekriterien am besten entspricht. Die Kriterien wurden eingangs von Herrn Lernbass erläutert. Auch andere Kombinationen wären jederzeit möglich.

7. Folie

Ein weiteres Produkt ist das EDA Screening. Dieses wird derzeit von Banken, Diözesen, Stiftungen, Ärztekammern und Pensionskassen in Anspruch genommen. Entsprechende Vorgabekriterien können exakt mittels EDA überwacht werden.