

## Über uns

Soehnholz ESG GmbH bietet auf [www.soehnholzesg.com](http://www.soehnholzesg.com) innovative regelbasierte und besonders nachhaltige ETF- und Aktien-Modellportfolios für Vermögensverwalter, Berater und Vermittler (B2B) an. Anleger können über frei wählbare B2B Partner Zugang zu den Portfolios bekommen. Über die Soehnholz Asset Management GmbH wird zudem der FutureVest Equity Sustainable Development Goals Fonds angeboten.

Prof. Dr. Dirk Söhnholz ist Geschäftsführer und über die Söhnholz Advisors GmbH auch alleiniger Anteilseigner der Soehnholz ESG und der Soehnholz Asset Management GmbH. Dirk Söhnholz (geb. 1963) arbeitet - nach Stationen als Unternehmensberater und in der Industrie - seit 1999 in der Anlagebranche: 12 Jahre im (semi-)institutionellen Geschäft bei der Feri in Bad Homburg und von 2012 bis 2015 bei dem ETF-Spezialisten Veritas Investment GmbH, bei der er 2013 ESG-Kriterien für Aktienfonds einführte.

Dirk ist seit 2014 Honorarprofessor für Asset-Management an der Universität Leipzig und hat zahlreiche Fachbeiträge veröffentlicht, z.B. „Asset Allocation, Risiko-Overlay und Manager-Selektion: Das Diversifikationsbuch“ (Co-Autor). Ebenfalls seit 2014 schreibt er Beiträge auf [www.prof-soehnholz.com](http://www.prof-soehnholz.com), wo er inzwischen wöchentlich auf neue wissenschaftliche Nachhaltigkeits(investment)forschung hinweist.

## RETRO-Investmentphilosophie mit Pure ESG und SDG Fokus

„Finanzprognosen sind schwierig, besonders wenn sie die Zukunft betreffen“ (unbekannter Verfasser). Sogenannte aktive Portfoliomanager verwenden in der Regel Prognosen und sind oft nicht sehr transparent. Soehnholz ESG ist anders. RETRO steht für regel- und evidenzbasiert, transparent, robust und optimierungsfrei. Das gilt für alle Allokationen und Wertpapierselektionen. Soehnholz ESG bietet vor allem Portfolios nach strengen Environmental, Social, und Governanceregeln (**Pure ESG**) und mit Fokus auf die Sustainable Development Goals (**SDG**) der Vereinten Nationen an.

## Die Portfolios

Soehnholz ESG startete Anfang 2016 mit wenigen neuartigen Portfolios. Das **ETF-Weltmarktportfolio** bildet die aggregierte Allokation von allen Kapitalanlegern weltweit kapitalgewichtet und damit „most-passive“ über alle Anlageklassen mit ETFs nach. Zeitgleich wurde das weltweit erste öffentliche **ESG ETF-Portfolio** gestartet. Davon gibt es auch Varianten nur aus Aktien-ETFs und nur aus Anleihe-ETFs.

Weil ESG-ETFs viele Nachhaltigkeitskompromisse machen, wurden 2017 direkte ESG- und ESG-SDG-Aktienportfolios gestartet. In den Folgejahren wurde das Angebot um mehrere innovative (ESG) **SDG-ETF-** und **ESG-SDG-Aktienportfolios** ergänzt.

Portfolios	Aktienanteil (inkl. Alts)	Ca. # Positionen	Ca. # Wertpapiere / Emittenten	Risikoklasse	Ca. ETF-Kosten (%)	Nachhaltigkeits-Score(%)
FuttrueVest Equity SDG R Fonds	100%	30	30	7*	---	100
Global Equities ESG SDG	100%	30	30	5	---	90
Global Equities ESG SDG Social	100%	30	29	7*	---	90
Global Equities ESG SDG Trend	100%	30	30	4	---	90
ESG ETF-Portfolio	60%	9	>2.200	4	0,21	30
ESG ETF-Portfolio ex Bonds	100%	6	>2.000	5	0,25	30
ESG ETF-Portfolio Bonds (EUR)	0%	8	>1.100	3	0,20	30
ESG ETF-Portfolio Bonds	0%	8	>1.100	4*	0,18	30
SDG ETF-Portfolio	100%	8	>300	6	0,41	55
SDG ETF-Portfolio Trend	100%	8	>300	5	0,41	55
Weltmarkt ETF-Portfolio Basis	62%	12	>1.800	4	0,19	0

Die Werte in der Tabelle sind gerundet. Die Risikoklassen sind auf Basis von Dreijahresvolatilitäten berechnet und die Nachhaltigkeitsscores basieren auf der aktuellen Nachhaltigkeitsinvestmentpolitik der Soehnholz ESG GmbH und dem DVFA PRISC Modell (Details siehe entsprechendes Kapitel in [Das Soehnholz ESG und SDG Portfoliobuch](#)).