

# SPDR<sup>®</sup> MSCI Japan Climate Paris Aligned UCITS ETF (Acc)

Informationsblatt

31 März 2024

**Umwelt, Soziales &  
Gesellschaft**

## Anlageziel des Fonds

Das Anlageziel des Fonds besteht darin, die Wertentwicklung der großen und mittelgroßen Segmente des japanischen Aktienmarktes abzubilden.

## Indexbeschreibung

Der MSCI Japan Climate Paris Aligned Index ist ein Index, der auf dem MSCI Japan Index aufbaut und Wertpapiere von Unternehmen mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung des japanischen Aktienmarktes umfasst. Der Index ist darauf ausgelegt, Anleger zu unterstützen, die ihr Engagement in Bezug auf Übergangsrisiken sowie physische Klimarisiken reduzieren und Chancen nutzen möchten, die sich aus dem Übergang zu einer kohlenstoffärmeren Wirtschaft ergeben, während sie gleichzeitig die Anforderungen des Übereinkommens von Paris erfüllen. Der Index berücksichtigt die TCFD-Empfehlungen und ist so konzipiert, dass er die Mindeststandards des Vergleichsindex der EU im Einklang mit dem Übereinkommen von Paris übertrifft.

## Steuerstatus

Standardgemäß ist die SSGA bestrebt, alle geltenden steuerlichen Berichtspflichten für alle SPDR ETFs in den folgenden Ländern einzuhalten. Anmeldungen erfolgen je nach der Zeitskala, die von der jeweiligen Steuerbehörde vorgegeben wird, das ganze Jahr über: Großbritannien, Deutschland, Österreich, Schweiz.

## Länder mit Vertriebszulassung

Spanien, Schweden, Österreich, Norwegen, Niederlande, Luxemburg, Italien, Irland, Großbritannien, Frankreich, Finnland, Deutschland, Dänemark

## Notierung

Börse	Börsenticker	Handelswährung	iNAV Code	Bloomberg Code	Reuters Code	SEDOL Code
Deutsche Börse*	SPF6	EUR	INSPF6E	SPF6 GY	SPF6.DE	BQQPV41

\*"Primary Listing"

## Fondsdaten

ISIN	IE00BQQPV184
Benchmark	MSCI Japan Climate Paris Aligned Index
Index Ticker	MXJPCLNJ
Index-Klassifizierung	Nettogesamtertrag
Anzahl An Titeln	95

## Schlüsselfaktoren

Auflagedatum	04-Mar-2022
Share Class Währung	JPY
Fonds — Basiswährung	JPY
TER	0,12%
Ertragsverwendung	Thesaurierend
Replikationsmethode	Nachbildung
UCITS-konform	Ja
SFDR-Fondsklassifizierung	SFDR – Artikel 8
Domizil	Irland
Investment Manager	State Street Global Advisors Europe Limited
Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited
Fonds-Umbrella	SSGA SPDR ETFs Europe II plc
Volumen Anteilsklasse (Mio.)	¥610,29
Volumen aller Anteilsklassen (Mio.)	¥610,29
ISA berechtigt	Ja
SIPP berechtigt	Ja
PEA berechtigt	Keine

Bitte beachten Sie, dass die Fondspreise aufgrund der Schließung aller SSGA SPDR ETF Europe I & II-Teilfonds am Freitag, den 29. März 2024, den Nettoinventarwert vom Donnerstag, den 28. März, widerspiegeln werden. Dies hat zur Folge, dass die monatlichen Fondsleistungszahlen von der Benchmark abweichen können.

Wertentwicklung					
	Index	Fonds vor Kosten (brutto)	Differenz	Fonds nach Kosten (netto)	Differenz
<b>Annualisierte Renditen (%)</b>					
1 Jahr	30,64	30,33	-0,32	30,17	-0,47
3 Jahre	-	-	-	-	-
5 Jahre	-	-	-	-	-
10 Jahre	-	-	-	-	-
Seit Auflage	18,14	17,92	-0,23	17,78	-0,37
<b>Kumulative Wertentwicklung (%)</b>					
1 Monat	1,57	1,33	-0,24	1,32	-0,25
3 Monate	12,54	12,24	-0,30	12,21	-0,33
1 Jahr	30,64	30,33	-0,32	30,17	-0,47
2 Jahre	32,37	31,95	-0,42	31,64	-0,74
3 Jahre	-	-	-	-	-
5 Jahre	-	-	-	-	-
10 Jahre	-	-	-	-	-
Seit Auflage	41,34	40,78	-0,56	40,43	-0,91
<b>Jahresrendite (%)</b>					
2024	12,54	12,24	-0,30	12,21	-0,33
2023	24,03	24,03	0,00	23,88	-0,15
2022	1,26	1,13	-0,14	1,03	-0,24

	Fonds (%)
<b>Standardabweichung (3 Jahre)</b>	-
<b>Annualisierter Tracking Error (3 Jahre)</b>	-

Die in der Vergangenheit erzielte Performance ist kein Indikator für die zukünftige Performance. In den vorliegenden Performancezahlen sind die Kommissionen und Kosten für die Ausgabe und Rücknahme sowie den Kauf und Verkauf von Anteilen nicht berücksichtigt. Wenn die Performance auf Basis des Nettoinventarwertes in einer anderen Währung als der Abrechnungswährung der kollektiven Kapitalanlage kalkuliert wird, kann der Wert infolge von Wechselkursschwankungen steigen oder fallen.

Wird der Fonds gemäß seinem offiziellen Nettoinventarwert (NIW)-Kalender geschlossen, doch es sind dessen ungeachtet Preise für einen maßgeblichen Teil der zugrunde liegenden Wertpapiere ermittelbar, wird ein technischer NIW berechnet. Die hierin angegebene frühere Wertentwicklung wurde daher erforderlichenfalls auf Grundlage eines technischen NIW und des offiziellen NIW des Fonds zu jedem anderen Geschäftstag des betreffenden Zeitraums berechnet.

Für das Kalenderjahr, in das das Auflegungsdatum entweder des betreffenden Fonds oder des an die vergangene Wertentwicklung gebundenen Fonds fällt (je nachdem welches das frühere Datum ist), ist die Angabe der Wertentwicklung im Kalenderjahr unvollständig.

Merkmale	
Anzahl der Vermögenswerte	94
† Ausschüttungsrendite	-
Kurs-Gewinn-Verhältnis für das laufende Jahr	22,53
Durchschnittliches Preis/Buch-Verhältnis	2,26
Durchschnittliche Marktkapitalisierung (Mio.)	¥6.909.661,57
Dividendenrendite des Index	1,59%

† Dieser Wert misst die historische Dividendenausschüttung je Aktie über zwölf Monate, geteilt durch den NIW.

Quelle: State Street Global Advisors Die aufgeführten Merkmale, Bestände, Länderallokationen und Sektoren entsprechen dem oben in diesem Factsheet angegebenen Datum und können sich ändern. Jegliche Bezugnahme auf ein bestimmtes Unternehmen oder Wertpapier stellt keine Empfehlung zum Kauf, Verkauf, Halten oder direkten Investieren in ein solches Unternehmen oder Wertpapier dar.

Top-10-Positionen	Gewichtung (%)
TOYOTA MOTOR CORP	4,53
SONY GROUP CORP	4,10
TOKYO ELECTRON LTD	3,81
KEYENCE CORP	3,43
JAPAN EXCHANGE GROUP INC	2,77
FAST RETAILING CO LTD	2,61
FANUC CORP	2,47
HOYA CORP	2,45
ADVANTEST CORP	2,39
SOFTBANK GROUP CORP	2,30

Sektorengewichtung	Gewichtung (%)
Informationstechnologie	22,34
Industrieunternehmen	16,03
Gesundheitswesen	15,60
Nicht-Basiskonsumgüter	15,23
Finanzen	9,99
Immobilien	9,78
Kommunikationsdienste	7,61
Basiskonsumgüter	2,02
Material	1,41

Geografische Aufteilung	Gewichtung (%)
Japan	100,00

**Kapitalrisiko: Eine Anlage ist mit Risiken verbunden, einschließlich des Risikos eines Kapitalverlusts. Die bisherige Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.**

## Kontaktieren Sie uns

Besuchen Sie unsere Webseite [ssga.com/etfs](http://ssga.com/etfs) oder kontaktieren Sie Ihren lokalen SPDR ETF Vertreter. Alternativ können Sie auch das SPDR ETF Sales & Support Team über [sprdrseurope@ssga.com](mailto:sprdrseurope@ssga.com) erreichen.

### Frankreich & Luxemburg

[spdretf\\_france@ssga.com](mailto:spdretf_france@ssga.com)  
+33 1 44 45 40 00

### Italien

[spdretf\\_italia@ssga.com](mailto:spdretf_italia@ssga.com)  
+39 0232066 140

### Nordics

[sprdrseurope@ssga.com](mailto:sprdrseurope@ssga.com)  
+31 (0)20-7181071

### Schweiz

[sprdrsschweiz@ssga.com](mailto:sprdrsschweiz@ssga.com)  
+ 41 (0)44 245 70 00

### Deutschland

[sprdrsgermany@ssga.com](mailto:sprdrsgermany@ssga.com)  
+49 69 66774 5016

### Niederlande

[sprdr\\_nl@ssga.com](mailto:sprdr_nl@ssga.com)  
+31 (0)20-7181071

### Spanien

[sprdrseurope@ssga.com](mailto:sprdrseurope@ssga.com)  
+39 0232066 140

### Großbritannien

[sprdrseurope@ssga.com](mailto:sprdrseurope@ssga.com)  
+44 (0) 203 395 6888

## ssga.com/etfs

### Glossar

**Kurs-Gewinn-Verhältnis in einem Geschäftsjahr** Zum Berichtsdatum der durchschnittliche Kurs jedes zugrunde liegenden Wertpapiers, dividiert durch die durchschnittliche EPS-Schätzung des Wertpapiers für das noch nicht gemeldete nächste Geschäftsjahr.

**Durchschnittliches Kurs-Buchwert-Verhältnis** Zum Berichtsdatum der durchschnittliche Kurs jedes zugrunde liegenden Wertpapiers, dividiert durch den Buchwert je Anteil des Wertpapiers.

**Dividendenrendite des Index** Zum Berichtsdatum der Durchschnitt der jährlichen Dividenden je Anteil von jedem Basiswertpapier des Index, dividiert durch den Kurs des Wertpapiers zum Berichtsdatum.

**TER** Bei der Total Expense Ratio handelt es sich um eine Gebühr, die dem Fonds als Prozentsatz des Nettoinventarwerts zur Deckung der mit dem Betrieb und dem Management des Vermögensportfolios verbundenen Kosten erhoben wird.

### Nur für professionelle Kunden / qualifizierte Anleger. Nicht für den öffentlichen Vertrieb.

Börsengehandelte Indexfonds (ETFs) werden wie Aktien gehandelt, unterliegen Anlagerisiken und ihr Marktwert schwankt. Der Wert der Anlage kann sowohl fallen als auch steigen, und die Rendite der Anlage ist deshalb veränderlich. Wechselkursänderungen können sich nachteilig auf Wert, Kurs oder Ertrag einer Anlage auswirken. Des Weiteren gibt es keine Garantie dafür, dass ein ETF sein Anlageziel erreichen wird.

### Marketingmitteilung

SPDR ETFs sind möglicherweise nicht für Sie erhältlich oder geeignet. Die hier erteilten Informationen stellen keine Anlageberatung gemäß Definition nach der Richtlinie über Märkte für Finanzinstrumente (2014/65/EG) dar und sollten nicht als Grundlage für eine Anlageentscheidung herangezogen werden. Sie sind auch nicht als Aufforderung zum Kauf oder als Angebot zum Verkauf einer Anlage zu verstehen. Die bestimmten Anlageziele, Strategien, der steuerliche Status, die Risikobereitschaft bzw. der Anlagehorizont eines Anlegers oder potenziellen Anlegers sind darin nicht berücksichtigt. Falls Sie Anlageberatung benötigen, sollten Sie sich an Ihren Steuer-, Finanz- oder sonstigen Fachberater wenden.

**Bitte lesen Sie die aktuellen wesentlichen Anlegerinformationen (WAI) und den Prospekt des Fonds, bevor Sie eine endgültige Anlageentscheidung treffen. Die aktuelle englische Fassung des Prospekts und der WAI finden Sie unter [www.ssga.com](http://www.ssga.com). Eine Zusammenfassung der Anlegerrechte finden Sie hier: <https://www.ssga.com/library-content/products/fund-docs/summary-of-investor-rights-ssga-sprdr-investors-rights-summary.pdf>** Beachten Sie, dass die **Verwaltungsgesellschaft beschließen kann, die für die Vermarktung getroffenen Vereinbarungen zu beenden und die Notifizierung gemäß Artikel 93a der Richtlinie 2009/65/EG zu löschen.**

Alle Dokumente in Bezug auf die Fonds sind kostenlos von den Geschäftsstellen des lokalen Vertreters/Vermittlers zu beziehen, stehen im Internet unter [www.ssga.com](http://www.ssga.com) zur Verfügung oder sind von State Street Custodial Services (Ireland) Limited, 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, Irland, erhältlich. SPDR ETFs ist die Plattform von State Street Global Advisors für börsengehandelte Indexfonds ("ETF") und enthält Fonds, die von der Central Bank of Ireland als offene OGAW-Investmentgesellschaften genehmigt wurden.

Für US-Anleger sind die Fonds nicht erhältlich. SSGA SPDR ETFs Europe I plc und SPDR ETFs Europe II plc („die Gesellschaft“) emittieren SPDR ETFs und bilden eine offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital und getrennter Haftung zwischen ihren Teilfonds. Die Gesellschaft ist als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) nach irischem Recht organisiert und als OGAW von der Central Bank of Ireland zugelassen.

**Zusätzliche wichtige Informationen:** - Für **Großbritannien** wurde dieses Dokument von State Street Global Advisors Limited („SSGA“) herausgegeben. Adresse des eingetragenen Sitzes: 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2. Registrierungsnummer 49934. Tel.: +353 (0)1 776 3000. Fax: +353 (0)1 776 3300. Internet: [www.ssga.com](http://www.ssga.com).

### Lokale Vertreter/Zahlstellen von SPDR ETFs:

**Frankreich:** State Street Bank International GmbH Paris Branch, Cœur Défense - Tour A, 100, Esplanade du Général de Gaulle, 92931 Paris La Defense Cedex; **Schweiz:** State Street Bank GmbH Munich, Niederlassung Zürich, Beethovenstrasse 19, 8027 Zürich, und die Hauptvertriebsstelle in der Schweiz, State Street Global Advisors AG, Beethovenstrasse 19, 8027 Zürich; **Deutschland:** State Street Global Advisors Europe Limited, Briener Strasse 59, D-80333 München; **Spanien:** Cecabank, S.A. Alcalá 27, 28014 Madrid (Spanien); **Dänemark:** Nordea Bank Denmark A/S, Issuer Services, Securities Services Hermes Hus, Helgeshøj Allé 33 Postbox 850, DK-0900 Kopenhagen C; **Österreich:** Erste Bank, Graben 21, 1010 Wien,

Österreich; **Schweden:** SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB, Global Transaction Services ST MHI, SE-106 40 Stockholm, Schweden. Der S&P 500® Index ist ein Produkt von S&P Dow Jones Indices LLC oder seinen verbundenen Unternehmen („S&P DJI“), für dessen Verwendung State Street Global Advisors eine Lizenz gewährt wurde. S&P®, SPDR®, S&P 500®, US 500 und die 500 sind eingetragene Marken von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“); Dow Jones® ist eine eingetragene Marke von Dow Jones Trademark Holdings LLC („Dow Jones“) und wurde für die Verwendung durch S&P Dow Jones Indices lizenziert; und für die Verwendung dieser Marken wurde S&P DJI eine Lizenz und State Street Global Advisors eine Unterlizenz für bestimmte Zwecke gewährt. Der Fonds wird von S&P DJI, Dow Jones, S&P und ihren jeweiligen verbundenen Unternehmen weder gesponsort oder anderweitig unterstützt noch verkauft oder beworben; die genannten Parteien sichern in keiner Weise die Ratsamkeit der Investition in dieses Produkt/diese Produkte zu und haften nicht für Fehler, Auslassungen oder Unterbrechungen in der Berechnung und Verbreitung dieser Indizes. Die hierin erwähnten Marken und Dienstleistungsmarken sind Eigentum ihrer jeweiligen Inhaber. Unabhängige Datendienste machen keinerlei Zusicherungen oder Garantien bezüglich der Richtigkeit, Vollständigkeit oder Aktualität der Daten und haften nicht für Schäden jeglicher Art im Zusammenhang mit der Nutzung dieser Daten. Dieses Werk darf ohne ausdrückliche schriftliche Einwilligung von SSGA weder ganz noch teilweise vervielfältigt, kopiert oder übertragen und sein Inhalt gegenüber Dritten nicht offengelegt werden.

## R-Factor™ Zusammenfassung

R-Factor™ wird aufgebaut anhand einer transparenten Bewertungsmethode, die die Materiality Map des Sustainability Accounting Standards Board (SASB), Corporate-Governance-Kodizes und Informationen von vier Best-in-Class-ESG-Datenanbietern nutzt. R-Factor unterstützt die Entwicklung nachhaltiger Kapitalmärkte, indem es Anlegern die Möglichkeit bietet, in Lösungen zu investieren, die finanziell wesentliche ESG-Daten integrieren, und Unternehmen gleichzeitig Anreize gibt, ihre ESG-Praktiken und die Veröffentlichungs- und Informationspolitik in maßgeblichen Bereichen zu optimieren.

Die angezeigten Daten innerhalb des Factsheet für die ESG Sektionen sind die aktuellsten zur Verfügung stehenden und haben einen 1-Monats Verzug gegenüber dem Berichtsdatum.

Quelle: Factset/SSGA. Positionen Stand 31 Mrz 2024, R-Faktor Stand 29 Feb 2024.

## R-Factor-Profil des Fonds

Nicht verfügbar	0,00%
Nachzügler	0,82%
Underperformer	5,57%
Durchschnitt	22,87%
Outperformer	35,25%
Spitzenreiter	35,49%

Quelle: Factset/SSGA zum Stand vom 29 Feb 2024.

## R-Factor

R-Factor-Zusammenfassung	Fonds
R-Factor	63

Quelle: Factset/SSGA zum Stand vom 29 Feb 2024.

Fondsberichterstattung	Anzahl	Prozentualer Anteil an den gesamten Wertpapieren (%)	Prozentualer Anteil am gesamten Marktwert (%)
R-Factor-Wertpapierberichterstattung	94	100,00	100,00
Gesamtanzahl der Wertpapiere im Fonds	94		

Quelle: Factset/SSGA zum Stand vom 29 Feb 2024.

Top-10-Positionen	Fondsgewichtung (%)	R-Factor-Rating
Toyota Motor Corp.	4,53	78
Sony Group Corporation	4,10	80
Tokyo Electron Ltd.	3,81	75
Keyence Corporation	3,43	49
Japan Exchange Group Inc.	2,77	59
FAST RETAILING CO. LTD.	2,61	53
Fanuc Corporation	2,47	68
HOYA CORPORATION	2,45	52
Advantest Corp.	2,39	73
SoftBank Group Corp.	2,30	65

### Höchste 5 R-Factor-Ratings

Japan Real Estate Investment Corp.	1,78	84
Shiseido Company Limited	0,41	81
Sony Group Corporation	4,10	80
Nomura Research Institute Ltd.	0,21	79
Toyota Motor Corp.	4,53	78

### Niedrigste 5 R-Factor-Ratings

Hikari Tsushin Inc.	0,70	22
Kobe Bussan Co. Ltd.	0,12	29
Keisei Electric Railway Co. Ltd.	1,83	32
MISUMI Group Inc.	0,08	35
Toho Co. Ltd.	0,16	37

Quelle: Factset/SSGA zum Stand vom 29 Feb 2024.

Aus der R-Factor-Zusammenfassung gehen lediglich bestimmte ESG-Merkmale hervor, nicht die Wertentwicklung des Fonds. Weitere Informationen und Definitionen der angegebenen ESG-Kennzahlen entnehmen Sie bitte dem Abschnitt Wichtige Informationen.

## Klima-Kennzahlen

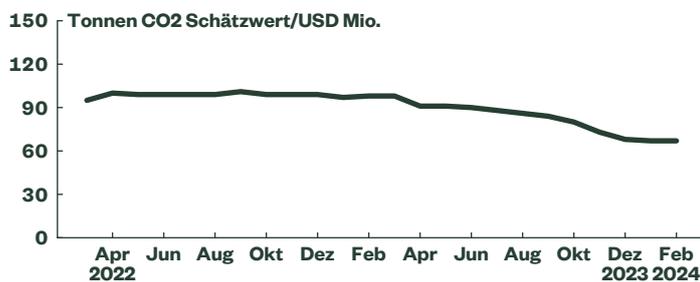
TCFD – Kohlenstoff-Kennzahlen	Fonds
TCFD – Gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität (WACI)	38,42
TCFD – Gesamte Kohlenstoffemissionen**	49,29*
TCFD – CO2-Bilanz	12,31
TCFD – Kohlenstoffintensität	31,57

Quelle: State Street Global Advisors, S&P Trucost, FactSet, Task Force on Climate-related Financial Disclosures (TCFD). Die Ergebnisse sind Schätzungen, die auf Annahmen und Analysen von State Street Global Advisors basieren. Sie sind nicht dazu gedacht, die tatsächlichen Ergebnisse eines Angebots darzustellen. Tatsächliche Ergebnisse können abweichen. \* Die TCFD-Kennzahl „Gesamte Kohlenstoffemissionen“ ordnet die Emissionen den Anlegern auf der Grundlage eines Eigenkapitalansatzes zu. Bei gemischten Fonds stellen die Ergebnisse die Umweltverantwortung des gesamten verwalteten Fondsvermögens dar. Für die Verantwortung des einzelnen Anteilnehmers kann eine anteilige Verantwortung auf der Grundlage des prozentualen Anteils der einzelnen Anlage berechnet werden. \*\* Die Kennzahl wird nicht zum Vergleich von Portfolios und Benchmarks verwendet, da die Daten nicht normalisiert sind.

Bitte beachten Sie, dass die vorherigen Factsheet seit November 2023 falsche Daten zu den Gesamtkohlenstoffemissionen (TCE) enthielten, die identifiziert und korrigiert wurden. Bitte wenden Sie sich an Ihren Kundenberater, wenn Sie weitere Informationen benötigen.

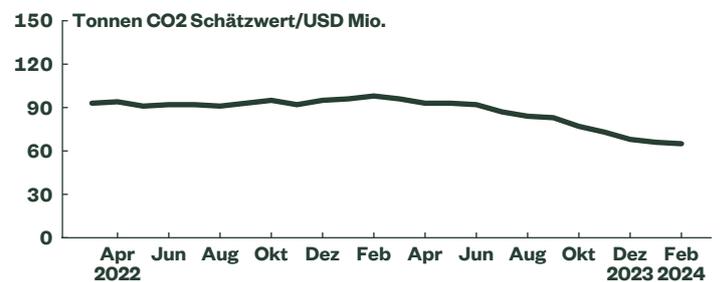
## Klimaprofil

### CO2-Intensität (Direkt + Indirekt)



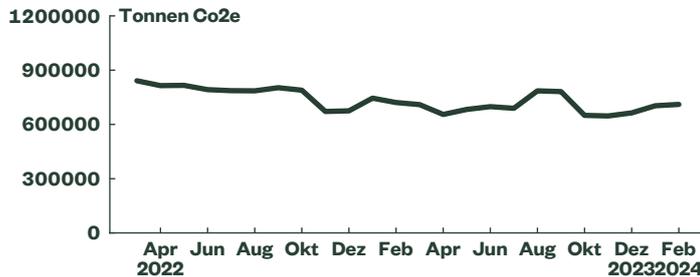
Fonds

### Gewichtete durchschnittliche CO2-Intensität (Direkt + Indirekt)



Fonds

### Kategorien 1 + 2 Kohlenstoffemissionen



Fonds

Quelle: SSGA Holdings per Stand 31 Mrz 2024. Trucost Daten per Stand 29 Feb 2024.

## Stewardship-Profil Q4 2023

Anzahl der Versammlungen mit Stimmabgabe	105
Anzahl der Länder	1
Vorschläge des Managements	37
Stimmen „Dafür“	94,59%
Stimmen „Dagegen“	5,41%
Vorschläge der Aktionäre	0
Für das Management	0,00%
Gegen das Management	0,00%

Die Zahlen beruhen auf dem allgemein von State Street Global Advisors verfolgten Ansatz zur Stimmabgabe bei den vom Fonds zu Quartalsende gehaltenen Unternehmen. Diese Angaben ersetzen nicht den Bericht über die Stimmabgabe, der über Ihren Kundenbetreuer angefordert werden kann.

Das Asset-Stewardship-Programm von State Street Global Advisors (SSGA) soll mit unseren Fondsunternehmen in Dialog treten zu Fragen, die sich bei allen Aspekten im Zusammenhang mit Umwelt, Sozialem und Governance (ESG) auf die langfristige Wertschöpfung auswirken. In der jüngeren Vergangenheit hat SSGA ausführliche Vorgaben zu maßgeblichen Governance-Sachverhalten herausgegeben wie effektive unabhängige Führung durch den Verwaltungsrat. Derzeit liegt der Fokus von SSGA darauf, Verwaltungsratsgremien dabei zu unterstützen, über potenzielle Auswirkungen ökologischer und sozialer Fragen nachzudenken und bei ihrer Aufsicht über die langfristige Strategie als solides Geschäftsgebaren eine Nachhaltigkeitsperspektive einzubeziehen.

## ssga.com/etfs

**R-Factor™** R-Factor™ ist ein ESG-Scoring-System, das allgemein anerkannte transparente wesentlichsbezogene Rahmenwerke nutzt, die von einer großen Zahl von Unternehmen und Anlegern unterstützt werden, um einen einzigartigen ESG-Score für börsennotierte Unternehmen zu ermitteln. Der Score basiert auf ESG-Daten von vier verschiedenen Anbietern (Sustainalytics, ISS-Oekom, Vigeo-EIRIS und ISS-Governance), um die Gesamtabdeckung zu verbessern und Verzerrungen existierender Bewertungsmethoden zu beseitigen. R-Factor™ soll Unternehmen in die Lage versetzen, bei der Schaffung nachhaltiger Märkte zu helfen.

**R-Factor™ Scores** sind branchenübergreifend vergleichbar. Die ESG- und Corporate-Governance (CorpGov)-Scores basieren ihrer Konzeption nach auf Themen, die für die Branche und die regulatorische Region eines Unternehmens wesentlich sind. Eine einheitliche Bewertungsskala ermöglicht die Interpretation des endgültigen Score eines Unternehmens, da somit unternehmensübergreifende Vergleiche angestellt werden können.

**Der R-Factor™** Scoring-Prozess setzt sich aus zwei zugrundeliegenden Komponenten zusammen. Die erste Komponente basiert auf dem vom Sustainability Accounting Standards Board („SASB“) veröffentlichten Rahmenwerk. Dieses wird mit Ausnahme von Corporate-Governance-Belangen für alle ESG-Aspekte des Scores verwendet. Das SASB-Rahmenwerk strebt danach, diejenigen ESG-Risiken zu identifizieren, die basierend auf seiner Branchenzugehörigkeit für einen Emittenten von finanzieller Wichtigkeit sind. Diese Komponente des R-Factor™ Scores wird nur anhand der Kennzahlen der ESG-Datenanbieter bestimmt, die sich speziell mit den ESG-Risiken befassen, die vom SASB-Rahmenwerk für den Emittenten, basierend auf seiner Branchenzugehörigkeit, als finanziell wesentlich identifiziert wurden.

Die zweite Komponente des Scores ist der CorpGov-Score. Dieser wird anhand von regionspezifischen Corporate-Governance-Kodizes generiert, die von Anlegern oder Aufsichtsbehörden entwickelt wurden. Governance-Kodizes beschreiben die Mindestanforderungen an die Corporate

Governance in einer bestimmten Region und beziehen sich für gewöhnlich auf Themen wie Aktionärsrechte, die Unabhängigkeit des Verwaltungsrats und die Vergütung von Führungskräften. Diese Komponente des R-Factor™ verwendet die von ISS Governance bereitgestellten Daten, um den Emittenten gemäß diesen Governance-Kodizes einen Governance-Score zuzuordnen.

**R-Factor™ Profil** Innerhalb jeder Branchengruppe werden die Emittenten, basierend auf dem Perzentil ihrer R-Factor™ Scores, in fünf verschiedene ESG-Performance-Gruppen eingestuft. Ein Unternehmen wird in eine der fünf ESG-Performance-Gruppen (Nachzügler - 10 % des Universums, Underperformer - 20 % des Universums, durchschnittlicher Performer - 40 % des Universums, Outperformer - 20 % des Universums oder Spitzenreiter - 10 % des Universums) eingeordnet, indem der R-Factor™ Score eines Unternehmens auf einer Skala verglichen wird. R-Factor™ Scores werden gewöhnlich mit normierten Ratings auf einer Bewertungsskala von 0-100 verteilt. Abweichungen zwischen der Anzahl der Positionen in der R-Factor™-Übersicht und der Anzahl der Positionen im regulären Reporting-Paket können auftreten, denn die R-Factor™-Übersicht zählt die Anzahl der Emittenten und nicht die Anzahl der Positionen im Portfolio.

**Kohlenstoffintensität (Direkt+Indirekt)** Gemessen in Tonnen CO<sub>2</sub>e/USD Millionen Umsatz. Die Aggregation der CO<sub>2</sub>-Bilanzen von Indekskomponenten pro USD (gleichgewichtet) in der operativen und First-Tier-Lieferkette.

**Gewichteter Durchschnitt Kohlenstoffintensität (Direkt+Indirekt)** Gemessen in Tonnen CO<sub>2</sub>e/USD Millionen Umsatz. Der gewichtete Durchschnitt der Intensitäten der einzelnen Unternehmen (Emissionen aus der operativen und First-Tier-Lieferkette gegenüber den Umsatz), gewichtet nach dem Anteil der einzelnen Komponenten des Index.

**Kategorien 1 + 2 Kohlenstoffemissionen** Gemessen in Tonnen CO<sub>2</sub>e. Die Treibhausgasemissionen aus Betriebsabläufen, die sich im Besitz oder unter der Kontrolle des Unternehmens befinden, sowie die Treibhausgasemissionen aus dem Verbrauch von durch das Unternehmen bezogener Elektrizität, Wärme oder Dampf.

**TCFD - Gewichtete durchschnittliche**

## Geschlechterdiversität

Frauen im Verwaltungsrat	Anzahl der Wertpapiere
0	11
1	40
2	27
3	10
4	3
5	3
6	0
7	0
8	0
9	0
10	0
10+	0
Nicht verfügbar	0
<b>Gesamt</b>	<b>94</b>

Quelle: Factset/SSGA zum Stand vom 29 Feb 2024.

**Kohlendioxid-Emissionsintensität** - Das Engagement des Portfolios in kohlenstoffintensiven Unternehmen, ausgedrückt in Tonnen CO<sub>2</sub>e/Mio. USD Umsatz. Scope-1- und Scope-2-THG-Emissionen werden den Portfoliogewichtungen (der aktuelle Wert der Anlage im Verhältnis zum aktuellen Portfoliowert) entsprechend umgelegt.

**TCFD - Gesamte Kohlendioxidemissionen** - Die absoluten Treibhausgasemissionen, die mit einem Portfolio verbunden sind, ausgedrückt in Tonnen CO<sub>2</sub>e. Scope-1- und Scope-2-THG-Emissionen werden auf der Grundlage eines Eigenkapitalansatzes auf Anleger umgelegt.

**TCFD - CO<sub>2</sub>-Bilanz** - Gesamte Kohlendioxidemissionen eines Portfolios, die nach dem Marktwert des Portfolios normalisiert und in Tonnen CO<sub>2</sub>e/investierte Mio. USD ausgedrückt werden. Scope-1- und Scope-2-THG-Emissionen werden auf der Grundlage eines Eigenkapitalansatzes auf Anleger umgelegt.

**TCFD - Kohlendioxid-Emissionsintensität** - Volumen der Kohlendioxidemissionen pro Mio. USD Umsatz (Kohlendioxidintensität eines Portfolios), ausgedrückt in Tonnen CO<sub>2</sub>e/Mio. USD Umsatz. Scope-1- und Scope-2-THG-Emissionen werden auf der Grundlage eines Eigenkapitalansatzes auf Anleger umgelegt.

**Geschlechterdiversität** Wir verwenden derzeit den FactSet-eigenen Datensatz „People“, um die Anzahl der Frauen im Verwaltungsrat für jedes Portfoliounternehmen des Fonds zu ermitteln.

Die Daten und Kennzahlen wurden zum Zeitpunkt dieses Berichts von den folgenden Stellen wie nachstehend erläutert erhoben und unterliegen den unten aufgeführten Hinweisen. Alle anderen Daten stammen von SSGA.

**Trucost-Abschnitte** Kohlenstoffintensität (Direkt+Indirekt), Gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität (Direkt+Indirekt), Scope 1 + 2 Kohlenstoffemissionen, Total Reserves CO<sub>2</sub> Emissionen

Trucost™ ist eine eingetragene Marke von S&P Trucost Limited („Trucost“) und wird unter Lizenz verwendet. Der ESG-Bericht wird in keiner Weise von Trucost oder seinen Konzerngesellschaften (zusammen die „Lizenzgebenden Parteien“) gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben, und keine der lizenzgebenden Parteien gibt irgendwelche Behauptungen oder Prognosen bzw. Erklärungen oder Zusicherungen, ob

ausdrücklich oder stillschweigend, hinsichtlich (i) der Ergebnisse, die durch die Verwendung der Trucost-Daten in dem Bericht erzielt werden können, oder hinsichtlich (ii) der Eignung der Trucost-Daten für den Zweck, zu dem sie im Zusammenhang mit dem Bericht verwendet werden, ab. Keine der lizenzgebenden Parteien erteilt eine Finanz- oder Anlageberatung oder Empfehlung in Bezug auf den Bericht. Keine der lizenzgebenden Parteien haftet (ob aus Fahrlässigkeit oder anderweitig) anderen Personen gegenüber für Fehler in den Trucost-Daten oder ist verpflichtet, andere Personen über Fehler darin zu informieren.

**FactSet-Abschnitte** Geschlechtervielfalt Diese Publikation kann urheberrechtlich geschützte Informationen von FactSet enthalten („FactSet-Informationen“), die ohne die ausdrückliche, vorherige schriftliche Zustimmung von FactSet nicht vervielfältigt, verwendet, verbreitet, verändert oder in irgendeiner Weise veröffentlicht werden dürfen. Die FactSet-Informationen werden „wie gesehen“ bereitgestellt, und alle Zusicherungen und Gewährleistungen, ob mündlich oder schriftlich, ausdrücklich oder stillschweigend (nach allgemeinem Recht oder gesetzlich oder anderweitig), werden hiermit ausgeschlossen und abgelehnt, soweit dies gesetzlich zulässig ist. Insbesondere in Bezug auf die FactSet-Informationen lehnt FactSet jegliche stillschweigende Gewährleistung der Marktgängigkeit und Eignung für einen bestimmten Zweck ab und übernimmt keine Garantie im Hinblick auf Richtigkeit, Vollständigkeit, Aktualität, Funktionalität und/oder Zuverlässigkeit. Die FactSet-Informationen sind nicht als Anlageberatung zu verstehen. Sämtliche Meinungen oder Behauptungen in einer Veröffentlichung mit FactSet-Informationen (und/oder die FactSet-Informationen selbst) stellen nicht die Meinungen oder Überzeugungen von FactSet, seinen Konzerngesellschaften und/oder verbundenen Unternehmen und/oder einem ihrer jeweiligen Mitarbeiter dar. FactSet haftet nicht für Schäden, die sich aus der Verwendung dieser Publikation oder der hierin enthaltenen FactSet-Informationen ergeben.

© 2024 State Street Corporation. Alle Rechte vorbehalten. Falligkeit: 31/03/2025