

# SPDR® MSCI World Value UCITS ETF (Acc)

Informationsblatt

31 Mai 2024

## Aktien

★★★★

Morningstar Rating™

30 April 2024

### Anlageziel des Fonds

Das Anlageziel des Fonds ist die Nachbildung der Wertentwicklung von Aktienwerten globaler Industrieländer, wobei Aktien, die Merkmale einer niedrigen Bewertung aufweisen, höher gewichtet werden.

### Indexbeschreibung

Der Index misst die Performance von Aktien, die auf relativer Ebene ein höheres Engagement gegenüber dem Substanzfaktor (s. Definition in der Indexmethode) innerhalb von Industrieländern aufweisen, die im Mutterindex, dem MSCI World Index, vertreten sind. Ferner zielt der Index darauf ab, Unternehmen von geringer Qualität, gemessen an ihren bilanziellen Fundamentaldaten, einschließlich der Eigenkapitalrendite, der Verschuldungsquote und der Ertragsschwankungen, zu meiden.

### 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
Euronext Amsterdam*	WVAL	EUR	INWVALE	WVAL NA	WVAL.AS	BL3NN47
London Stock Exchange	VALW	GBP	INWVALP	VALW LN	VALW.L	BKV8RJ0
London Stock Exchange	WVAL	USD	INWVAL	WVAL LN	WVAL.L	BKV8RH8

\*\*Primary Listing\*

### Fondsinfos

ISIN	IE00BJXRT813
Benchmark	MSCI World Value Exposure Select Index
Index Ticker	NU720342
Index-Klassifizierung	Nettogesamtertrag
Anzahl An Titeln	346

### Schlüsselfaktoren

Auflegedatum	02-Sep-2020
Share Class Währung	USD
Fonds — Basiswährung	USD
TER	0,25%
Ertragsverwendung	Thesaurierend
Replikationsmethode	Nachbildung
UCITS-konform	Ja
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.)	US\$62,09
Volumen aller Anteilsklassen (Mio.)	US\$62,09
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
--	-------	---------------------------	-----------	---------------------------	-----------

**Annualisierte Renditen (%)**

1 Jahr	24,60	24,81	0,22	24,50	-0,10
3 Jahre	6,26	6,53	0,27	6,27	0,00
5 Jahre	-	-	-	-	-
10 Jahre	-	-	-	-	-
Seit Auflage	13,15	13,42	0,27	13,14	-0,01

**Kumulative Wertentwicklung (%)**

1 Monat	3,82	3,93	0,11	3,91	0,09
3 Monate	5,24	5,37	0,13	5,30	0,06
1 Jahr	24,60	24,81	0,22	24,50	-0,10
2 Jahre	22,78	23,39	0,61	22,78	0,00
3 Jahre	19,99	20,91	0,92	20,01	0,02
5 Jahre	-	-	-	-	-
10 Jahre	-	-	-	-	-
Seit Auflage	58,73	60,17	1,44	58,69	-0,05

**Jahresrendite (%)**

2024	6,96	7,17	0,21	7,05	0,10
2023	22,79	22,97	0,18	22,66	-0,13
2022	-10,65	-10,39	0,26	-10,62	0,04
2021	19,32	19,58	0,26	19,28	-0,04
2020	13,37	13,43	0,06	13,34	-0,03

	Fonds (%)
Standardabweichung (3 Jahre)	15,86
Annualisierter Tracking Error (3 Jahre)	0,15

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	349
† Ausschüttungsrendite	-
Kurs-Gewinn-Verhältnis für das laufende Jahr	10,25
Durchschnittliches Preis/Buch-Verhältnis	1,25
Durchschnittliche Marktkapitalisierung (Mio.)	US\$81.182,08
Dividendenrendite des Index	3,49%

† 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 (%)
CISCO SYSTEMS INC	3,26
QUALCOMM INC	3,23
APPLIED MATERIALS INC	2,37
INTEL CORP	2,07
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,92
TOYOTA MOTOR CORP	1,91
AT&T INC	1,78
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1,58
COMCAST CORP-CLASS A	1,55
HSBC HOLDINGS PLC	1,53

Sektorengewichtung	Gewichtung (%)
Informationstechnologie	24,27
Finanzen	15,24
Gesundheitswesen	11,89
Industrieunternehmen	10,98
Nicht-Basiskonsumgüter	10,30
Kommunikationsdienste	7,85
Basiskonsumgüter	6,48
Energie	4,43
Material	3,81
Versorgungsunternehmen	2,62
Immobilien	2,12

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

Geografische Aufteilung	Gewichtung (%)
USA	39,59
Japan	19,88
Großbritannien	11,33
Frankreich	6,80
Deutschland	5,49
Schweiz	3,42
Italien	2,21
Kanada	1,85
Australien	1,43
Hong Kong	1,38
Niederlande	1,18
Spanien	1,15
Schweden	0,98
Israel	0,92
Finnland	0,64
Singapur	0,34
Dänemark	0,30
Österreich	0,28
Norwegen	0,27
Irland	0,20
Belgien	0,10

Geografische Aufteilung (Weitere)	Gewichtung (%)
Andere	0,26

## 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 [spdrseurope@ssga.com](mailto:spdrseurope@ssga.com) erreichen.

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

**Deutschland**  
[spdrsgermany@ssga.com](mailto:spdrsgermany@ssga.com)  
+49 69 66774 5016

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

**Niederlande**  
[spdr\\_nl@ssga.com](mailto:spdr_nl@ssga.com)  
+31 (0)20-7181071

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

**Spanien**  
[spdrseurope@ssga.com](mailto:spdrseurope@ssga.com)  
+39 0232066 140

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

**Großbritannien**  
[spdrseurope@ssga.com](mailto:spdrseurope@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-spdr-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. Zugelassen und reguliert von der Financial Conduct Authority, registriert unter der Nr. 2509928. USt. Nr. 5776591 81. Eingetragener Sitz: 20 Churchill Place, Canary Wharf, London, E14 5HJ Telefon: 020 3395 6000, Fax: 020 3395 6350, Internet: [www.ssga.com](http://www.ssga.com). **Für die EU** wurde dieses Dokument von State Street Global Advisors Europe („SSGA“), reguliert von der Central Bank of Ireland, 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, Brienner 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 MH1, 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 Datendienstleistungen 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.

Der Empfänger ist nur berechtigt, die Indexdaten in der Form anzusehen oder zu erhalten, in der sie vorgelegt werden. Der Empfänger nimmt zur Kenntnis und erklärt sich damit einverstanden, dass die Nutzung der Indexdaten auf eigenes Risiko erfolgt. Der Empfänger nimmt zur Kenntnis und erklärt sich damit einverstanden, dass die Indexdaten so, wie sie sind, bereitgestellt werden und dass weder Morningstar UK Limited (Morningstar) noch ihre Inhalte-Anbieter die Richtigkeit, Vollständigkeit, Nichtverletzung, Echtheit, Aktualität oder sonstige Merkmale der Indexdaten garantieren. Ferner nimmt der Empfänger zur Kenntnis und erklärt sich damit einverstanden, dass die Indexdaten Ihnen als Anleger in Finanzprodukten ausschließlich gemäß regulatorischen Vorschriften und nur zu Informationszwecken bereitgestellt werden. Die Indexdaten dürfen von Ihnen nicht zu kommerziellen Zwecken oder zu Handels- oder anderen Zwecken anstelle eines Abonnements dieser Indexdaten von Morningstar verwendet werden.

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.

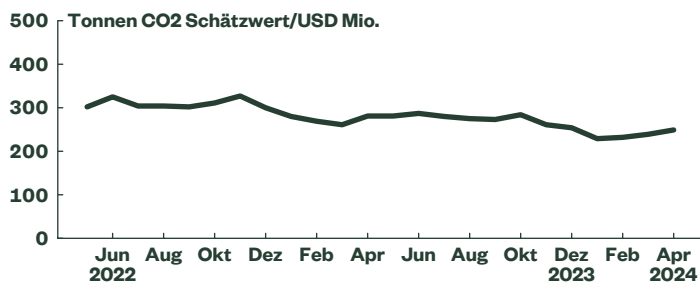
## Klima-Kennzahlen

TCFD – Kohlenstoff-Kennzahlen	Fonds
TCFD – Gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität (WACI)	101,12
TCFD – Gesamte Kohlenstoffemissionen**	5.696,64*
TCFD – CO2-Bilanz	92,43
TCFD – Kohlenstoffintensität	123,55

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.

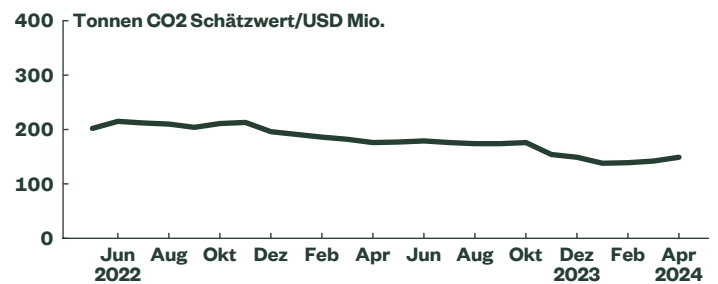
## Klimaprofil

### CO2-Intensität (Direkt + Indirekt)



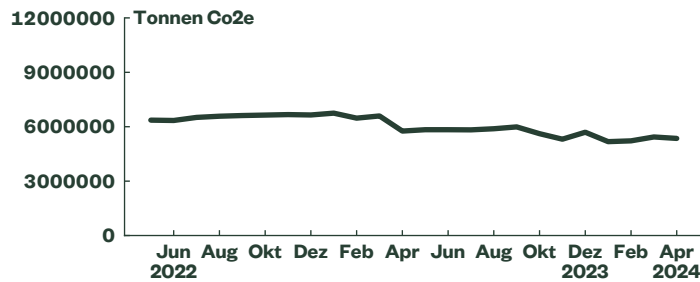
■ Fonds

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



■ Fonds

### Kategorien 1 + 2 Kohlenstoffemissionen



■ Fonds

Quelle: SSGA Holdings per Stand 31 Mai 2024. Trucost Daten per Stand 30 Apr 2024.

## Stewardship-Profil Q1 2024

Anzahl der Versammlungen mit Stimmabgabe	382
Anzahl der Länder	12
Vorschläge des Managements	816
Stimmen „Dafür“	95,22%
Stimmen „Dagegen“	4,78%
Vorschläge der Aktionäre	18
Für das Management	72,22%
Gegen das Management	27,78%

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 Geschäftsgebahren eine Nachhaltigkeitsperspektive einzubeziehen.

Geschlechterdiversität	
Frauen im Verwaltungsrat	Anzahl der Wertpapiere
0	8
1	42
2	52
3	64
4	74
5	43
6	37
7	20
8	5
9	2
10	2
10+	0
Nicht verfügbar	0
<b>Gesamt</b>	<b>349</b>

Quelle: Factset/SSGA zum Stand vom 30 Apr 2024.

## ssga.com/etfs

Die oben angegebenen ESG-/ Nachhaltigkeitsinformationen dienen nur zu Informationszwecken. Diese Informationen sollen den Anlegern Transparenz im Hinblick auf Umwelt-, Sozial- oder Governance-Merkmale des Fonds bieten. Die Bereitstellung dieser Informationen sollte nicht als Darstellung des aktuellen oder zukünftigen Anlageziels des Fonds ausgelegt werden, noch sollte sie als Indikator der aktuellen oder zukünftigen Anlageentscheidungen des Fondsmanagers betrachtet werden. **Dieser Fonds strebt keine nachhaltige, Impact- oder ESG-Strategie an.**

Anleger sollten eine Anlage in den Fonds nicht ausschließlich auf der Grundlage der oben genannten Informationen bewerten, sondern auch andere Faktoren wie das allgemeine Anlageziel und das Risikoprofil des Fonds berücksichtigen. Ausführlichere Informationen über den Fonds sollten Anleger im [https://www.ssga.com/fund-finder?tab=documents] des Fonds nachlesen.

Die obigen Drittinformationen wurden aus Quellen bezogen, die zum angegebenen Datum als zuverlässig galten, aber ihre Richtigkeit kann nicht garantiert werden. SSGA haftet nicht für Anlageentscheidungen, die auf diesen Informationen beruhen, und Sie sollten daher diese Informationen nicht als verlässlich betrachten. Es wird keine Gewähr oder Garantie für die aktuelle Richtigkeit, Zuverlässigkeit oder Vollständigkeit dieser Informationen übernommen.

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

### Gewichteter Durchschnitt

**Kohlendioxidintensität (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

**Kohlendioxidemissionen** 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 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** Kohlendioxidintensität (Direkt+Indirekt), Gewichtete durchschnittliche Kohlendioxidintensität (Direkt+Indirekt), Scope 1 + 2 Kohlendioxidemissionen, Total Reserves CO<sub>2</sub> Emissions

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 Marktängigkeit 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. Fälligkeit: 31/05/2025