

# SPDR<sup>®</sup> MSCI Europe Consumer Staples UCITS ETF

Informationsblatt

31 August 2023

## Aktien

★ ★ ★

Morningstar Rating™

31 Juli 2023

### Anlageziel des Fonds

Das Anlageziel des Indexfonds besteht darin, die Wertentwicklung des Index MSCI Europe Consumer Staples mit Wiederanlage der Nettodividenden nachzubilden. Dieser Index repräsentiert sämtliche dem Sektor der zyklischen Konsumgüter zugehörigen europäischen Aktien (ohne Nahrungsmittel).

### Indexbeschreibung

Der MSCI Europe Consumer Staples 35/20 Capped Index ist ein am Streubesitz orientierter Marktkapitalisierungsindex, der die Wertentwicklung der Unternehmen im MSCI Europe Index, die gemäß Global Industry Classification Standard unter die Kategorie "Basiskonsumgüter" fallen, messen soll.

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

### Fondsdaten

|                       |   |
|-----------------------|---|
| ISIN                  | IE00BKWQ0D84                                    |
| Benchmark             | MSCI Europe Consumer Staples 35/20 Capped Index |
| Index Ticker          | NE731541  |
| Index-klassifizierung | Nettogesamtertrag                               |
| Anzahl An Titeln      | 39  |

### Schlüsselfaktoren

|                                     |   |
|-------------------------------------|---|
| Auflagedatum                        | 05-Dec-2014                                 |
| Share Class Währung                 | EUR   |
| Fonds — Basiswährung                | EUR   |
| TER                                 | 0,18%                                       |
| 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.)        | €370,77                                     |
| Volumen aller Anteilsklassen (Mio.) | €370,77                                     |
| ISA berechtigt                      | Ja  |
| SIPP berechtigt                     | Ja  |
| PEA berechtigt                      | Keine                                       |

Indexänderung „Index“ spiegelt die verknüpften Wertentwicklungsrenditen des MSCI Europe Consumer Staples 35/20 Capped Index und des MSCI Europe Consumer Staples Index wider. Die Indexwertentwicklungen spiegeln den MSCI Europe Consumer Staples Index von der Fondsauflegung bis zum November 30, 2020 und den MSCI Europe Consumer Staples 35/20 Capped Index gültig ab dem November 30, 2020 bis heute wider.

### Notierung

| Börse                     | Börsenticker | Handelswährung | iNAV Code | Bloomberg Code | Reuters Code | SEDOL Code |
|---------------------------|--------------|----------------|-----------|----------------|--------------|------------|
| Euronext Paris*           | STS          | EUR            | INSTS     | STS FP         | SPSTS.PA     | BM67J12    |
| SIX Swiss Exchange        | STXS         | CHF            | INSTS     | STXS SE        | STXS.S       | BM67J34    |
| Deutsche Börse            | SPYC         | EUR            | INSTS     | SPYC GY        | SPYC.DE      | BKX4031    |
| London Stock Exchange     | CSTP         | EUR            | INSTS     | CSTP LN        | CSTP.L       | BSBNC18    |
| Borsa Italiana            | STXS         | EUR            | INSTS     | STXS IM        | STXS.MI      | BM67J23    |
| Bolsa Mexicana de Valores | CSTPN        | MXN            |           | CSTPN MM       | CSTPN.MX     | BJCW8T1    |
| London Stock Exchange     | CSPE         | GBP            | INSTSP    | CSPE LN        | CSPE.L       | BKWQ0D8    |

\*"Primary Listing"

**Wertentwicklung**

|  | Index | Fonds vor Kosten (brutto) | Differenz | Fonds nach Kosten (netto) | Differenz |
|--|-------|---------------------------|-----------|---------------------------|-----------|
|--|-------|---------------------------|-----------|---------------------------|-----------|

**Annualisierte Renditen (%)**

|              |      |      |      |      |       |
|--------------|------|------|------|------|-------|
| 1 Jahr       | 0,79 | 0,93 | 0,14 | 0,75 | -0,04 |
| 3 Jahre      | 5,84 | 6,00 | 0,16 | 5,78 | -0,06 |
| 5 Jahre      | 5,03 | 5,19 | 0,16 | 4,94 | -0,10 |
| 10 Jahre     | 6,83 | 6,98 | 0,15 | 6,69 | -0,14 |
| Seit Auflage | 7,46 | 7,51 | 0,05 | 7,12 | -0,34 |

**Kumulative Wertentwicklung (%)**

|              |        |        |      |        |        |
|--------------|--------|--------|------|--------|--------|
| 1 Monat      | -1,77  | -1,77  | 0,00 | -1,78  | -0,01  |
| 3 Monate     | 0,25   | 0,26   | 0,01 | 0,21   | -0,04  |
| 1 Jahr       | 0,79   | 0,93   | 0,14 | 0,75   | -0,04  |
| 2 Jahre      | 3,08   | 3,34   | 0,26 | 2,96   | -0,11  |
| 3 Jahre      | 18,56  | 19,09  | 0,53 | 18,35  | -0,22  |
| 5 Jahre      | 27,82  | 28,80  | 0,98 | 27,23  | -0,59  |
| 10 Jahre     | 93,65  | 96,34  | 2,69 | 91,07  | -2,58  |
| Seit Auflage | 383,81 | 389,03 | 5,21 | 351,20 | -32,62 |

**Jahresrendite (%)**

|      |       |       |      |       |       |
|------|-------|-------|------|-------|-------|
| 2023 | 4,44  | 4,59  | 0,14 | 4,46  | 0,02  |
| 2022 | -8,30 | -8,19 | 0,11 | -8,36 | -0,06 |
| 2021 | 20,48 | 20,56 | 0,08 | 20,29 | -0,20 |
| 2020 | -3,51 | -3,28 | 0,23 | -3,57 | -0,06 |
| 2019 | 25,31 | 25,52 | 0,21 | 25,15 | -0,16 |
| 2018 | -8,94 | -8,74 | 0,20 | -9,01 | -0,07 |

|  | Fonds (%) |
|--|-----------|
| <b>Standardabweichung (3 Jahre)</b>            | 13,15     |
| <b>Annualisierter Tracking Error (3 Jahre)</b> | 0,08      |

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                     | 40          |
| † Ausschüttungsrendite                        | -           |
| Kurs-Gewinn-Verhältnis für das laufende Jahr  | 17,05       |
| Durchschnittliches Preis/Buch-Verhältnis      | 3,11        |
| Durchschnittliche Marktkapitalisierung (Mio.) | €119.431,05 |
| Dividendenrendite des Index                   | 3,05%       |

† 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 (%) |
|------------------------------|----------------|
| NESTLE SA-REG                | 25,79          |
| UNILEVER PLC                 | 10,33          |
| L OREAL                      | 8,52           |
| DIAGEO PLC                   | 7,42           |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 5,66           |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC  | 4,15           |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV   | 3,97           |
| PERNOD RICARD SA             | 3,23           |
| DANONE                       | 3,01           |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N | 2,55           |

| Branchenzuordnung                           | Gewichtung (%) |
|---|----------------|
| Nahrungsmittel                              | 35,10          |
| Körperpflegeprodukte                        | 21,73          |
| Getränke                                    | 21,24          |
| Basiskonsumgüter: Vertrieb und Einzelhandel | 7,80           |
| Tabak                                       | 7,23           |
| Haushaltsartikel                            | 6,91           |

| Geografische Aufteilung | Gewichtung (%) |
|-------------------------|----------------|
| Großbritannien          | 34,92          |
| Schweiz                 | 28,11          |
| Frankreich              | 15,89          |
| Niederlande             | 6,96           |
| Belgien                 | 4,21           |
| Deutschland             | 3,08           |
| Norwegen                | 1,39           |
| Irland                  | 1,19           |
| Dänemark                | 1,14           |
| Schweden                | 1,14           |
| Portugal                | 0,57           |
| Italien                 | 0,54           |
| Finnland                | 0,42           |
| Andere                  | 0,43           |

**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

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

### Deutschland

[sprdrgermany@ssga.com](mailto:sprdrgermany@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 lösen.**

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).

**Für Mexiko**, diese Informationen stellen kein Marketing bzw. kein Angebot von Wertpapieren dar und sind auch nicht dazu bestimmt und nicht derart auszulegen. Die hierin genannten Fonds wurden und werden nicht nach dem mexikanischen Wertpapiermarktgesetz (Ley del Mercado de Valores) registriert und dürfen in den Vereinigten Mexikanischen Staaten nicht öffentlich angeboten oder verkauft werden. Offenlegungsunterlagen im Zusammenhang mit einem der oben aufgeführten Fonds dürfen in Mexiko nicht öffentlich vertrieben werden, und Anteile der Fonds dürfen nicht in Mexiko gehandelt werden.

#### 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 MH1, SE-106 40 Stockholm, Schweden.

Die Finanzprodukte, auf die hierin Bezug genommen wird, werden von MSCI weder gesponsert, empfohlen noch beworben, und MSCI übernimmt hinsichtlich dieser Finanzprodukte oder eines Index, auf dem diese Finanzprodukte basieren, keinerlei Haftung. Der Prospekt enthält eine detailliertere Beschreibung der begrenzten Beziehung, die MSCI zu SSGA und damit verbundenen Finanzprodukten hat.

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 gesponsert 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 Datendienstleister 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.

## 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 Aug 2023, R-Faktor Stand 31 Jul 2023.

## R-Factor-Profil des Fonds

|                 |        |
|-----------------|--------|
| Nicht verfügbar | 0,00%  |
| Nachzügler      | 0,00%  |
| Underperformer  | 0,00%  |
| Durchschnitt    | 3,01%  |
| Outperformer    | 6,04%  |
| Spitzenreiter   | 90,95% |

Quelle: Factset/SSGA zum Stand vom 31 Jul 2023.

## R-Factor

| R-Factor-Zusammenfassung | Fonds | Benchmark |
|--------------------------|-------|-----------|
| R-Factor                 | 82    | 82        |

Quelle: Factset/SSGA zum Stand vom 31 Jul 2023.

| Fondsberichterstattung                | Anzahl | Prozentualer Anteil an den gesamten Wertpapieren (%) | Prozentualer Anteil am gesamten Marktwert (%) |
|---------------------------------------|--------|--|---|
| R-Factor-Wertpapierberichterstattung  | 40     | 100,00   | 100,00  |
| Gesamtanzahl der Wertpapiere im Fonds | 40     |  |   |

Quelle: Factset/SSGA zum Stand vom 31 Jul 2023.

| Top-10-Positionen               | Fondsgewichtung (%) | Benchmark-Gewichtung (%) | Differenz (%) | R-Factor-Rating |
|---------------------------------|---------------------|--------------------------|---------------|-----------------|
| Nestle S.A.                     | 25,79               | 26,54                    | -0,75         | 82              |
| Unilever PLC                    | 10,33               | 10,33                    | -0,01         | 81              |
| L'Oreal S.A.                    | 8,52                | 8,49                     | 0,03          | 95              |
| Diageo plc                      | 7,42                | 7,40                     | 0,01          | 89              |
| British American Tobacco p.l.c. | 5,66                | 5,64                     | 0,02          | 76              |
| Reckitt Benckiser Group plc     | 4,15                | 4,13                     | 0,01          | 81              |
| Anheuser-Busch InBev SA/NV      | 3,97                | 3,96                     | 0,01          | 82              |
| Pernod Ricard SA                | 3,23                | 3,25                     | -0,02         | 91              |
| Danone SA                       | 3,01                | 3,00                     | 0,00          | 99              |
| Koninklijke Ahold Delhaize N.V. | 2,55                | 2,56                     | 0,00          | 67              |

### Höchste 5 R-Factor-Ratings

|                           |      |      |       |    |
|---------------------------|------|------|-------|----|
| Danone SA                 | 3,01 | 3,00 | 0,00  | 99 |
| L'Oreal S.A.              | 8,52 | 8,49 | 0,03  | 95 |
| Henkel AG & Co. KGaA      | 0,58 | 0,58 | 0,01  | 94 |
| Henkel AG & Co. KGaA Pref | 1,03 | 1,04 | -0,01 | 94 |
| Carrefour SA              | 0,93 | 0,91 | 0,01  | 92 |

### Niedrigste 5 R-Factor-Ratings

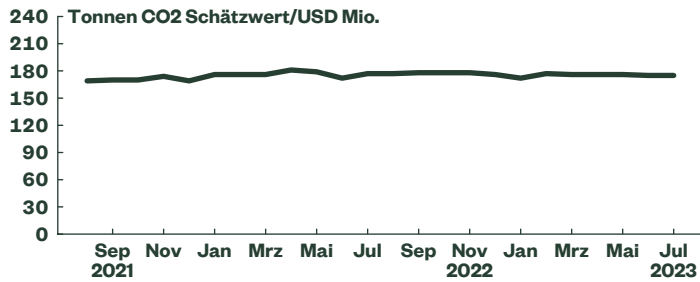
|                     |      |      |       |    |
|---------------------|------|------|-------|----|
| Ocado Group PLC     | 0,52 | 0,51 | 0,01  | 51 |
| Haleon PLC          | 1,82 | 1,66 | 0,16  | 53 |
| Lotus Bakeries NV   | 0,26 | 0,00 | 0,26  | 56 |
| HelloFresh SE       | 0,42 | 0,42 | -0,01 | 57 |
| Imperial Brands PLC | 1,57 | 1,59 | -0,02 | 61 |

Quelle: Factset/SSGA zum Stand vom 31 Jul 2023.

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.

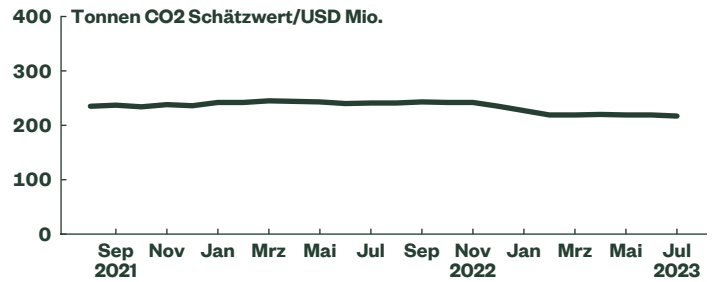
## Klimaprofil

### CO2-Intensität (Direkt + Indirekt)



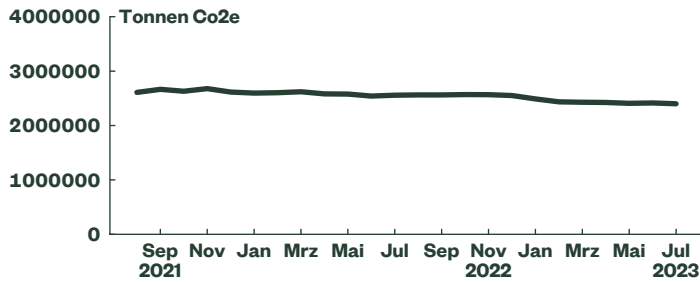
Fonds

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



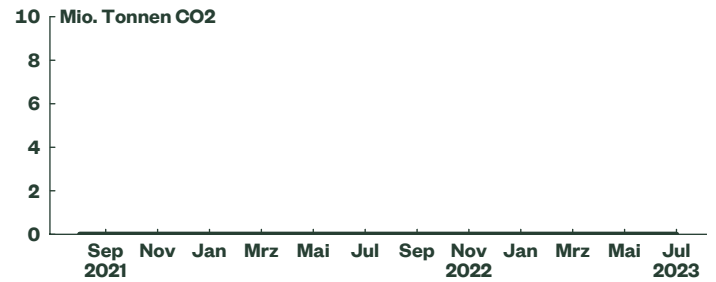
Fonds

### Kategorien 1 + 2 Kohlenstoffemissionen



Fonds

### Gesamtreserven Kohlenstoffemissionen



Fonds

Quelle: SSGA Holdings per Stand 31 Aug 2023. Trucost Daten per Stand 31 Jul 2023.

## Stewardship-Profil Q2 2023

|  |          |
|--|----------|
| Anzahl der Versammlungen mit Stimmabgabe | 32       |
| Anzahl der Länder                        | 9        |
| Vorschläge des Managements               | 630      |
| Stimmen „Dafür“                          | 87,62%   |
| Stimmen „Dagegen“                        | 12,38%   |
| <b>Vorschläge der Aktionäre</b>          | <b>0</b> |
| 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 Geschäftsgebahren eine Nachhaltigkeitsperspektive einzubeziehen.

| Geschlechterdiversität   |                        |
|--------------------------|------------------------|
| Frauen im Verwaltungsrat | Anzahl der Wertpapiere |
| 0                        | 0                      |
| 1                        | 2                      |
| 2                        | 5                      |
| 3                        | 3                      |
| 4                        | 9                      |
| 5                        | 13                     |
| 6                        | 4                      |
| 7                        | 1                      |
| 8                        | 3                      |
| 9                        | 0                      |
| 10                       | 0                      |
| 10+                      | 0                      |
| Nicht verfügbar          | 0                      |
| <b>Gesamt</b>            | <b>40</b>              |

Quelle: Factsset/SSGA zum Stand vom 31 Jul 2023.

## ssga.com/etfs

**R-Factor™** R-Factor™ ist ein ESG-Scoring-System, das allgemein anerkannte transparente wesentlichkeitsbezogene 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-Eliris 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 Wesentlichkeit 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 regionenspezifischen 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.

Beispiele für die öffentliche Sprache in Bezug auf den R-Factor finden Sie in der ELR-Registrierungserklärung hier: <https://www.sec.gov/Archives/edgar/data/1107414/000119312519192334/d774617d497.htm>

**Kohlenstoffintensität** 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**

**Kohlenstoffintensität** 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.

**Total Reserves CO<sub>2</sub> Emissions** Gemessen in Tonnen CO<sub>2</sub>e. Die CO<sub>2</sub>-Bilanz, die entstehen

könnte, wenn die nachgewiesenen und wahrscheinlichen fossilen Brennstoff-Reserven der Indexwerte verbrannt würden, pro investierter Million USD. Im Gegensatz zur Kohlenstoffintensität und den CO<sub>2</sub>-Emissionen ist die Kennzahl der S&P Trucost Total Reserves Emissions ein sehr spezifischer Indikator, der nur für eine sehr begrenzte Zahl von Unternehmen in mineralgewinnenden und kohlenstoffintensiven Branchen Anwendung findet. Diesen Unternehmen werden von Trucost numerische Ergebnisse bezogen auf ihre Emissionen gegenüber bestehenden Gesamtreserven (Total Reserves Emissions) zugewiesen, während der Rest der Portfoliobestände aus anderen Branchen keine numerischen Werte aufweist und stattdessen „null“, also leere Werte anzeigt. Um einen umfassenderen Überblick über die gewichteten durchschnittlichen fossilen Brennstoff-Reserven eines Portfolios in ihrer Gesamtheit zu erhalten, ersetzt State Street Global Advisors leere Ergebnisse durch „Nullen“. Obschon dadurch das endgültige gewichtete Durchschnittsvolumen leicht unterschätzt werden könnte, liefert diese Methode ein realistischeres Ergebnis, da die meisten Unternehmen in den globalen Indizes selbst keine fossilen Brennstoff-Reserven ihr Eigen nennen.

**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, Gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität, Scope 1 + 2 Kohlenstoffemissionen, 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 besehen“ 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.

© 2023 State Street Corporation. Alle Rechte vorbehalten. Fälligkeit: 31/08/2024