

SPDR[®] MSCI Emerging Markets Climate Paris Aligned UCITS ETF (Acc)

Foglio informativo

30 aprile 2024

Environmental, Social & Governance

Obiettivo del Fondo

L'obiettivo di investimento del Fondo è di replicare la performance del mercato azionario dei mercati emergenti.

Descrizione dell'indice

L'indice MSCI Emerging Markets Climate Paris Aligned si basa sull'indice MSCI Emerging Markets, il suo indice di partenza, e comprende titoli a media e grande capitalizzazione di 24 Paesi dei Mercati Emergenti (ME). L'indice è concepito per supportare gli investitori che desiderano ridurre la propria esposizione ai rischi climatici e legati alla transizione e che intendono cogliere le opportunità derivanti dalla transizione verso un'economia a basse emissioni di anidride carbonica, allineandosi ai requisiti dell'Accordo di Parigi. L'indice incorpora le raccomandazioni del TCFD ed è concepito per superare gli standard minimi del Benchmark UE allineato agli accordi di Parigi.

Regime Fiscale

Di norma, SSGA punta a soddisfare tutti i requisiti di informativa fiscale applicabili per tutti gli ETF SPDR nei paesi di seguito elencati. Le domande vengono presentate nel corso dell'intero anno a seconda dei termini previsti dalle singole autorità tributarie locali: Regno Unito, Germania, Austria, Svizzera.

Paesi di registrazione

Svezia, Spagna, Regno Unito, Paesi Bassi, Norvegia, Lussemburgo, Italia, Irlanda, Germania, Francia, Finlandia, Danimarca, Austria

Informazioni sul Fondo

ISIN	IE00BYTH5263
Benchmark	MSCI Emerging Markets Climate Paris Aligned Index
Codice Indice	MXEFOLPA
Tipo Indice	Rendimento Totale Netto
Numero Di Componenti	418

Dati Principali

Data di lancio	18-Jul-2022
Valuta della classe di azioni	USD
Fondo — Valuta di Base	USD
TER	0,23%
Politica dei Dividendi	Accumulazione
Metodologia di Replica	Replicato
Armonizzazione UCITS	Sì
Classificazione SFDR del fondo	Articolo 8 SFDR
Domicilio	Irlanda
Società di gestione	State Street Global Advisors Europe Limited
Società di gestione delegata	State Street Global Advisors Limited
Società Emittente	SSGA SPDR ETFs Europe II plc
Asset della Classe di Azioni (milioni)	US\$4,23
Asset Totali del Fondo (milioni)	US\$4,23
Idoneo ISA	Sì
Idoneo SIPP	Sì
Idoneo PEA	No

Si prega di notare che a causa della chiusura di tutti i comparti SSGA SPDR ETF Europe I e II di venerdì 29 marzo 2024, i prezzi dei fondi rifletteranno il NAV di giovedì 28 marzo, il che significa che le performance mensili del fondo potrebbero differire rispetto al benchmark.

Quotazioni

Borsa	Codice Borsa	Valuta di Negoziazione	Codice iNAV	Codice Bloomberg	Codice Reuters	Codice SEDOL
Deutsche Börse*	SPF7	EUR	INSPF7E	SPF7 GY	SPF7.DE	BYTH526
Borsa Italiana	MCPA	EUR	INSPF7E	MCPA IM	MCPA.MI	BNDQPB1
Euronext Amsterdam	SMPA	EUR	INSPF7E	SMPA NA	SMPA.PA	BNDQPF5
London Stock Exchange	SMPA	GBP	INSPF7P	SMPA LN	SMPA.L	BNDQPC2

*Indicare la borsa principale

Performance					
	Indice	Fondo Lorde	Differenza	Fondo Nette	Differenza
Performance Annualizzata (%)					
1 Anno	7,54	7,19	-0,35	6,94	-0,60
3 Anni	-	-	-	-	-
5 Anni	-	-	-	-	-
10 Anni	-	-	-	-	-
Dal Lancio	2,73	2,56	-0,17	2,33	-0,40
Performance Cumulativa (%)					
1 Mese	0,03	0,34	0,31	0,32	0,29
3 Mesi	8,05	8,08	0,03	8,02	-0,03
1 Anno	7,54	7,19	-0,35	6,94	-0,60
2 Anni	-	-	-	-	-
3 Anni	-	-	-	-	-
5 Anni	-	-	-	-	-
10 Anni	-	-	-	-	-
Dal Lancio	4,92	4,62	-0,30	4,19	-0,73
Performance (Anno Solare) (%)					
2024	1,88	1,92	0,04	1,84	-0,04
2023	7,60	7,23	-0,37	6,98	-0,62
2022	-4,29	-4,27	0,02	-4,37	-0,08

	(%) Fondo
Deviazione standard (3 Anni)	-
Tracking Error Annualizzato (3 Anni)	-

La performance storica non offre garanzia di rendimenti futuri. I dati di performance qui riportati non tengono conto delle commissioni e dei costi di emissione o rimborso, o acquisto e vendita, delle quote. Se la performance è calcolata sulla base di valori patrimoniali netti non denominati nella valuta di base del fondo, il suo valore potrebbe aumentare o diminuire a seguito della fluttuazione dei tassi di cambio.

Qualora il Fondo sia chiuso nel rispetto del calendario del Valore Patrimoniale Netto (VPN) ufficiale ma, ciononostante, sia possibile determinare una parte significativa dei prezzi dei titoli sottostanti, si calcola un VPN tecnico. Pertanto, i risultati ottenuti nel passato qui riportati sono stati calcolati utilizzando un VPN tecnico, ove necessario, oltre al VPN ufficiale del Fondo in ciascun altro giorno lavorativo per il periodo in esame.

Se la data di lancio del Fondo in questione o del Fondo legato alla performance storica (la prima delle due in ordine di tempo) cade in detto periodo, i rendimenti della performance nell'anno solare del lancio saranno parziali.

Caratteristiche

Numero di Titoli	398
*Distribution Yield	-
Rapporto prezzo/utigli - FY1	16,40
Price/Book medio	2,49
Media capitalizzazione di mercato (in Milioni)	US\$102.716,60
Dividend Yield dell'Indice	2,27%

* Misura i dividendi distribuiti negli ultimi 12 mesi per azione divisi per il NAV.

Fonte: SSGA Le caratteristiche, le posizioni, le scomposizioni geografiche e settoriali indicati sono aggiornati alla data indicata nella parte superiore di questo factsheet e sono soggetti a modifiche. Qualsiasi riferimento a una società o ad un titolo specifico non costituisce una raccomandazione ad acquistare, vendere, detenere o investire direttamente in tale società o titolo.

Le 10 Principali Posizioni	Peso (%)
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	10,38
TENCENT HOLDINGS LTD	4,43
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	3,28
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	2,51
BHARAT ELECTRONICS LTD	2,16
DELTA ELECTRONICS INC	1,87
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	1,47
SAMSUNG SDI CO LTD	1,42
ICICI BANK LTD	1,28
AL RAJHI BANK	1,18

Ripartizione Per Settore	Peso (%)
Information Technology	26,49
Finanziari	22,30
Beni di consumo ciclici	12,34
Industria	11,05
Servizi di Comunicazione	8,97
Beni di consumo non ciclici	6,42
Sanità	4,64
Materiali	2,81
Immobili	2,76
Utilities	2,22

Ripartizione Per Paese	Peso (%)
Cina	23,83
India	20,21
Taiwan	18,46
Corea	9,83
Arabia Saudita	5,52
Brasile	4,81
Messico	3,60
Sudafrica	2,74
Tailandia	2,52
Polonia	2,10
Perù	1,06
Cile	0,96
Malesia	0,89
Indonesia	0,71
Qatar	0,65
Grecia	0,58
Ungheria	0,41
Kuwait	0,35
Repubblica Ceca	0,23
Turchia	0,23
Filippine	0,12
UAE	0,11
Colombia	0,06

Rischio di capitale: L'investimento implica alcuni rischi, tra i quali il rischio di perdita di capitale. La performance passata non è un indicatore affidabile di quella futura.

Contattaci

Visita il nostro sito all'indirizzo ssga.com/etfs o contatta un rappresentante locale del team SPDR. In alternativa, contatta il nostro team di supporto SPDR ETFs all'indirizzo spdrseurope@ssga.com.

Francia & Lussemburgo

spdretf_france@ssga.com
+33 1 44 45 40 00

Italia

spdretf_italia@ssga.com
+39 0232066 140

Nordics

spdrseurope@ssga.com
+31 (0)20-7181071

Svizzera

spdrsswitzerland@ssga.com
+ 41 (0)44 245 70 00

Germania

spdrsgermany@ssga.com
+49 69 66774 5016

Paesi Bassi

spdr_nl@ssga.com
+31 (0)20-7181071

Spagna

spdrseurope@ssga.com
+39 0232066 140

Regno Unito

spdrseurope@ssga.com
+44 (0) 203 395 6888

ssga.com/etfs

Glossario

Rapporto prezzo/utigli AF1 Il prezzo medio di ciascun titolo sottostante diviso per la stima media dell'utile per azione (EPS) del titolo nel successivo esercizio finanziario non dichiarato, alla data di rendicontazione.

Media del prezzo/valore contabile La media del prezzo di ciascun titolo sottostante divisa per il valore contabile per azione del titolo, alla data di rendicontazione.

Rapporto dividendo/prezzo dell'indice La media dei dividendi annui per azione (DPS) di ciascun titolo sottostante nell'indice alla data di rendicontazione divisa per il prezzo del titolo alla data di rendicontazione.

TER Il Total Expense Ratio è una commissione addebitata al fondo, come percentuale del Valore patrimoniale netto, a copertura dei costi associati al funzionamento e alla gestione del portafoglio di attivi.

Per uso esclusivo di clienti professionali / investitori qualificati. Non destinato alla distribuzione al pubblico.

Gli ETF (Exchange Traded Fund) vengono negoziati come i titoli azionari, comportano un rischio d'investimento e il loro valore di mercato è soggetto a fluttuazioni. Il valore degli investimenti può sia aumentare sia diminuire, pertanto il rendimento degli investimenti sarà variabile. Le oscillazioni dei tassi di cambio possono causare effetti negativi sul valore, sulla quotazione o sul reddito di un investimento. Inoltre non viene fornita alcuna garanzia che l'ETF raggiunga l'obiettivo d'investimento.

Comunicazione commerciale

Gli ETF SPDR potrebbero non essere disponibili o adeguati all'investitore. Le informazioni fornite

non costituiscono una consulenza agli investimenti così come questa espressione è definita nella Direttiva MiFID (2014/65/UE) e l'investitore non dovrà farvi affidamento. Non devono intendersi come sollecitazione all'acquisto o offerta alla vendita di qualsiasi investimento. Non prendono in considerazione particolari orizzonti o obiettivi d'investimento, status fiscali, strategie o propensioni al rischio di qualsiasi investitore attuale o potenziale. Qualora si renda necessaria una consulenza agli investimenti, suggeriamo di consultare il proprio consulente fiscale e finanziario o altro professionista di fiducia.

Il presente documento non costituisce un'offerta o un invito all'acquisto di azioni di SPDR ETFs Europe I plc e SPDR ETFs Europe II plc.

Prima di prendere qualsiasi decisione di investimento, si prega di fare riferimento all'ultimo Documento contenente le informazioni chiave (KID) o Documento contenente le informazioni chiave per l'investitore (KIID) e al Prospetto informativo del Fondo. L'ultima versione in inglese del prospetto informativo e del KID/KIID è disponibile sul sito www.ssga.com. Un riepilogo dei diritti degli investitori è disponibile all'indirizzo: <https://www.ssga.com/library-content/products/fund-docs/summary-of-investor-rights/ssga-spd-investors-rights-summary.pdf> Si noti che la Società di gestione può decidere di rescindere gli accordi presi per la commercializzazione e procedere con la denotifica in conformità all'Articolo 93a della Direttiva 2009/65/CE.

Tutti i documenti relativi al fondo sono disponibili gratuitamente presso la sede del Rappresentante/Agente locale, visitando il sito www.ssga.com o contattando State Street Custodial Services (Ireland) Limited, 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, Irlanda. SPDR ETFs è la piattaforma di exchange traded fund ("ETF") di State Street Global Advisors ed

include fondi autorizzati dalle Banca centrale irlandese come fondi aperti d'investimento UCITS.

I fondi non sono disponibili per gli investitori statunitensi.

SSGA SPDR ETFs Europe I plc e SPDR ETFs Europe II plc (la "Società") emettono ETF di SPDR, e sono strutturate come società d'investimento di tipo aperto a capitale variabile e con separazione delle passività fra i comparti. La Società è organizzata come Organismo di investimento collettivo in valori mobiliari (OICVM) di diritto irlandese e autorizzata come OICVM dalla Banca centrale irlandese.

Informazioni aggiuntive importanti:

Per il Regno Unito, il presente documento è stato pubblicato da State Street Global Advisors Limited ("SSGA"). Autorizzata e disciplinata dalla Financial Conduct Authority (autorità di vigilanza britannica) ed è iscritta nel registro delle imprese con il numero 2509928. Partita IVA 5776591 81. Sede legale: 20 Churchill Place, Canary Wharf, London, E14 5HJ Telefono: 020 3395 6000 - Fax: 020 3395 6350 - Sito web: www.ssga.com.

Per l'UE, il presente documento è stato pubblicato da State Street Global Advisors Europe ("SSGA"), regolamentata dalla Banca Centrale d'Irlanda. Indirizzo della sede legale: 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2. Numero di iscrizione 49934. T: +353 (0)1 776 3000. Fax: +353 (0)1 776 3300. Web: www.ssga.com.

Rappresentante locale/Agenti di pagamento di SPDR ETFs:

Francia: State Street Bank International GmbH Paris Branch, Cœur Défense - Tour A, 100, Esplanade du Général de Gaulle, 92931 Paris La Defense Cedex; **Svizzera:** State Street Bank GmbH Munich, Zurich Branch, Beethovenstrasse 19, 8027 Zurich e il distributore principale in Svizzera, State Street Global Advisors AG, Beethovenstrasse 19, 8027 Zurich; **Germania:** State Street Global Advisors Europe Limited, Brienner Strasse 59, D-80333 Munich; **Spagna:** Cecabank, S.A. Alcalá 27,

28014 Madrid (Spain); **Danimarca:** Nordea Bank Denmark A/S, Issuer Services, Securities Services Hermes Hus, Helgeshøj Allé 33 Postbox 850 DK-0900 Copenhagen C; **Austria:** Erste Bank, Graben 21, 1010 Wien, Austria;

Svezia: SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB, Global Transaction Services ST MHI, SE-106 40 Stockholm, Svezia.

L'indice S&P 500® è un prodotto di S&P Dow Jones Indices LLC o delle sue affiliate ("S&P DJI") ed è stato concesso in licenza d'uso a State Street Global Advisors. S&P®, SPDR®, S&P 500®, US 500 e 500 sono marchi registrati di Standard & Poor's Financial Services LLC ("S&P"); Dow Jones® è un marchio registrato di Dow Jones Trademark Holdings LLC ("Dow Jones") ed è stato concesso in licenza d'uso da S&P Dow Jones Indices; questi marchi sono stati concessi in licenza d'uso da S&P DJI e concessi in sub-licenza per fini specifici da State Street Global Advisors. Il fondo non è sponsorizzato, sostenuto, venduto o promosso da S&P DJI, Dow Jones, S&P, e le rispettive affiliate e nessuna di tali parti rilascia alcuna dichiarazione in merito all'opportunità di investire in tali prodotti, né ha alcuna responsabilità per eventuali errori, omissioni o interruzioni di tali indici.

I marchi registrati e i marchi di servizio qui riferiti appartengono ai rispettivi proprietari. I fornitori di dati di terze parti non rilasciano garanzie o dichiarazioni di alcun tipo in merito all'accuratezza, alla completezza o alla puntualità dei dati e non hanno responsabilità per danni di alcun tipo relativi all'utilizzo di tali dati. È vietato riprodurre, copiare o trasmettere la totalità o parte del presente documento, né il suo contenuto può essere divulgato a terzi senza l'esplicita approvazione scritta di SSGA.

Sintesi del Fattore R™

Il Fattore R™ è ottenuto tramite una metodologia di assegnazione di un punteggio che sfrutta la Materiality Map, uno strumento del Sustainability Accounting Standards Board (SASB), i codici di corporate governance e le informazioni di quattro dei migliori fornitori di dati ESG. Il Fattore R sostiene lo sviluppo dei mercati dei capitali sostenibili, offrendo agli investitori la possibilità di investire in soluzioni che integrano dati ESG determinanti in ambito finanziario, incentivando al contempo le società affinché migliorino le pratiche e la comunicazione ESG nei settori rilevanti.

I dati inclusi nelle sezioni ESG di questa Factsheet sono gli ultimi disponibili e sono aggiornati al mese precedente rispetto alla data di riferimento del documento.
Fonte: Factset/SSGA. Posizioni aggiornate al 30 apr 2024, dati R-Factor al 31 mar 2024.

Profilo del Fattore R del Fondo

Non disponibile	0,44%
Fanalino di coda	6,16%
Sottoperformance	7,83%
Performance intermedia	27,17%
Sovraperformance	27,15%
Leader	31,25%

Fonte: Factset/SSGA al 31 mar 2024.

Fattore R

Sintesi del Fattore R	Fondo
Fattore R	60

Fonte: Factset/SSGA al 31 mar 2024.

Copertura del Fondo	Conteggio	Percentuale dei titoli totali (%)	Percentuale del valore di mercato totale (%)
Copertura titoli Fattore R	391	98,24	99,56
Numero totale di titoli nel Fondo	398		

Fonte: Factset/SSGA al 31 mar 2024.

Prime 10 posizioni	Ponderazione del Fondo (%)	Valutazione del Fattore R
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	10,39	84
Tencent Holdings Ltd.	4,44	62
Samsung Electronics Co. Ltd.	3,28	82
Alibaba Group Holding Limited	2,51	62
Bharat Electronics Limited	2,16	56
Delta Electronics Inc.	1,87	75
Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV Class B	1,47	59
Samsung SDI Co. Ltd	1,42	70
ICICI Bank Limited	1,28	54
AI Rajhi Bank	1,19	47

Prime 5 valutazioni del Fattore R		
Wipro Limited	0,30	85
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	10,39	84
Samsung Electronics Co Ltd Pfd Non-Voting	0,14	82
Samsung Electronics Co. Ltd.	3,28	82
Infosys Limited	1,10	81

Ultime 5 valutazioni del Fattore R		
Celltrion Pharm Inc.	0,03	7
Tianjin 7 12 Communication & Broadcasting Co. Ltd. Class A	0,01	10
Dar Al Arkan Real Estate Development Co.	0,17	15
Reinet Investments S.C.A.	0,18	15
Guangzhou Haige Communications Group Incorporated Company Class A	0,01	15

Fonte: Factset/SSGA al 31 mar 2024.

La sintesi del Fattore R rispecchia solo alcune caratteristiche ESG e non riflette la performance del fondo. Consultare la sezione sulle Informazioni importanti per maggiori dettagli e definizioni dei Parametri ESG presentati.

Indicatori sul Clima

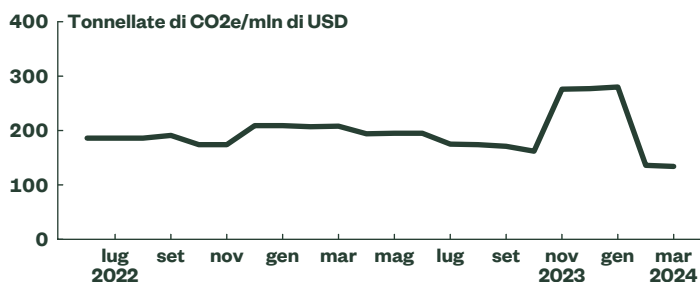
Indicatori sul Clima (TCFD)	Fondo
Intensità di Carbonio Media Ponderata (TCFD)	91,73
Emissioni totali di carbonio (TCFD)**	102,01*
Carbon Footprint (TCFD)	24,26
Intensità di Carbonio (TCFD)	86,80

Fonte: State Street Global Advisors, S&P Trucost, FactSet, Task Force on Climate-related Financial Disclosures (TCFD). I risultati sono stime basate su ipotesi e analisi effettuate da State Street Global Advisors. Non sono finalizzati a rappresentare i risultati effettivi di nessun prodotto offerto. I risultati effettivi potrebbero differire dalle stime. * Il parametro delle emissioni di carbonio totali della TCFD ripartisce le emissioni sugli investitori utilizzando un approccio basato sulla partecipazione azionaria. Nel caso dei fondi comuni di investimento, i risultati forniscono una sintesi della responsabilità ambientale sull'intero patrimonio in gestione del fondo. La responsabilità del singolo detentore si può calcolare sulla base della percentuale di quote detenute. ** Il parametro non viene utilizzato per confrontare i portafogli rispetto al benchmark perché i dati non sono normalizzati.

Si prega di notare che le schede informative precedenti a partire da novembre 2023 includevano dati errati sulle emissioni totali di carbonio (TOE) che sono stati identificati e corretti. Contatta il tuo Relationship Manager se hai bisogno di ulteriori dettagli.

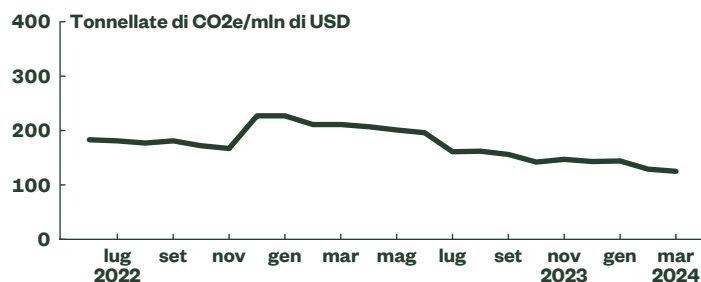
Profilo climatico

Intensità di carbonio (diretta + indiretta)



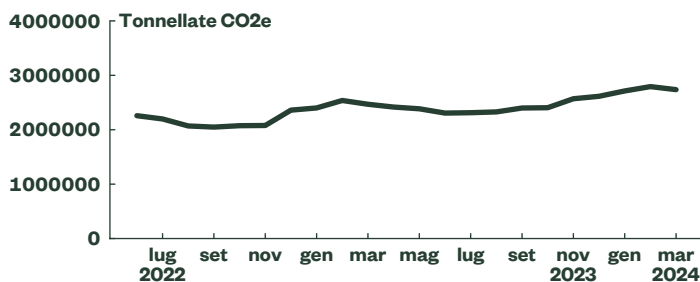
Fondo

Intensità di carbonio media ponderata (diretta + indiretta)



Fondo

Emissioni di carbonio di Scopo 1+2



Fondo

Fonte: SSGA Holdings al 30 apr 2024. Dati Trucost al 31 mar 2024.

Profilo di stewardship T1 2024

Numero di assemblee con voto	409
Numero di paesi	18
Proposte della direzione	755
Voti favorevoli	86,62%
Voti contrari	13,38%
Proposte degli azionisti	8
Con la direzione	100,00%
Contro la direzione	0,00%

I dati si basano sull'approccio generale di State Street Global Advisors relativamente al voto di fine trimestre sulle società detenute dal Fondo. Queste informazioni non sostituiscono una relazione sui voti per delega, che può essere richiesta al Responsabile delle relazioni.

Il programma di asset stewardship di State Street Global Advisors (SSGA) mira a interagire con le nostre società di fondi su questioni che influenzano la creazione di valore di lungo periodo attraverso considerazioni in materia ambientale, sociale e di governance (ESG). Nel recente passato, SSGA ha messo a disposizione linee guida dettagliate riguardanti questioni di governance fondamentali come, per esempio, una leadership efficace e indipendente del consiglio di amministrazione. L'obiettivo attuale di SSGA consiste nell'aiutare i consigli di amministrazione a riflettere sul potenziale impatto di questioni ambientali e sociali, integrando considerazioni sulla sostenibilità nelle attività di vigilanza del consiglio sulle strategie di lungo termine, come buona prassi aziendale.

ssga.com/etfs

Il Fattore R™ Il Fattore R™ è un sistema di punteggio ESG che sfrutta quadri trasparenti e di uso comune di valutazione della rilevanza, supportati da un ampio gruppo di società e investitori al fine di generare un punteggio ESG unico per le società quotate. Il punteggio è alimentato da dati ESG provenienti da quattro fornitori diversi (Sustainalytics, ISS-Oekom, Vigeo-EIRIS, e ISS-Governance), al fine di migliorare la copertura complessiva ed eliminare gli errori intrinseci delle metodologie di classificazione esistenti. Il Fattore R™ è progettato per attribuire alle società il potere di contribuire alla creazione di mercati sostenibili. I Punteggi del Fattore R™ sono confrontabili in tutti i settori. I punteggi ESG e Corporate Governance (CorpGov) sono progettati sulla base di questioni rilevanti per l'area di regolamentazione e il settore di una società. Una scala di valutazione uniforme permette di interpretare il punteggio di livello finale della società, per consentire confronti tra le diverse società. Il processo di assegnazione di un punteggio del Fattore R™ è costituito da due componenti sottostanti. Il primo componente si basa sul quadro pubblicato dal Sustainability Accounting Standards Board ("SASB"), che è utilizzato per tutti gli aspetti ESG del punteggio diversi da quelli relativi alle questioni di governance aziendale. Il quadro SASB cerca di identificare i rischi ESG che sono determinanti in ambito finanziario per l'emittente, sulla base della sua classificazione settoriale. Questo componente del punteggio del Fattore R™ è determinato utilizzando esclusivamente i parametri dei fornitori di dati ESG che riguardano specificamente i rischi ESG identificati dal quadro SASB, identificati come determinanti in ambito finanziario per l'emittente, sulla base della sua classificazione settoriale. Il secondo componente del punteggio, il punteggio CorpGov, è generato utilizzando codici di corporate governance specifici della regione, sviluppati da investitori o regolatori. I codici di governance descrivono le aspettative minime, in termini di corporate governance, di

una particolare regione e di norma attengono a temi quali i diritti degli azionisti, l'indipendenza del consiglio di amministrazione e la retribuzione della dirigenza. Questo componente del Fattore R™ utilizza dati forniti da ISS Governance per assegnare un punteggio di governance agli emittenti secondo tali codici di governance. **Profilo™ del Fattore R** All'interno di ciascun gruppo settoriale, gli emittenti sono classificati in base a cinque diversi gruppi di performance ESG, sulla base del percentile in cui si collocano i loro punteggi del Fattore R™. Ogni società è classificata in una delle cinque classi di performance ESG (Fanalino di coda: 10% dell'universo; Sottoperformance: 20% dell'universo; Performance intermedia: 40% dell'universo; Leader: 10% dell'universo), valutando il punteggio del Fattore R™ della società rispetto a una fascia. I punteggi del Fattore R™ vengono normalmente distribuiti utilizzando valutazioni normalizzate su una scala di valutazione da 0 a 100. Può verificarsi una discrepanza tra il numero di posizioni riportate nel Riepilogo R-Factor™ e il numero di posizioni nella reportistica periodica, in quanto il dato sul Riepilogo R-Factor™ è conteggiato in base al numero di emittenti piuttosto che al numero di posizioni in portafoglio. **Intensità di carbonio (diretta+indiretta)** Misurata in tonnellate di CO2e/ricavi in milioni di USD. L'aggregazione delle impronte di carbonio della filiera operativa e di primo livello dei componenti dell'indice per USD (equiponderate). **L'intensità di carbonio media ponderata (diretta+indiretta)** Misurata in tonnellate di CO2e/ricavi in milioni di USD. La media ponderata delle intensità delle singole società (emissioni della filiera operativa e di primo livello rispetto ai ricavi), in base alla proporzione di ciascun componente dell'indice. **Emissioni di carbonio di Scope 1+2** Misurate in tonnellate di CO2e. Le emissioni di gas serra provenienti dalle operazioni gestite o controllate dalla società, nonché le emissioni di gas serra derivanti dai consumi di elettricità, calore o vapore acquistati

Diversità di genere	
Donne nel Consiglio di amministrazione	Numero di titoli
0	50
1	118
2	106
3	63
4	37
5	12
6	9
7	2
8	1
9	0
10	0
10+	0
Non disponibile	0
Totale	398

Fonte: Factset/SSGA al 31 mar 2024.

dalla società. **Intensità di carbonio media ponderata TCFD** - Esposizione del portafoglio a società ad alta intensità di carbonio, espressa in tonnellate CO2e / mln USD di ricavi. Le emissioni di gas serra Scope 1 e Scope 2 sono allocate in base ai pesi del portafoglio (il valore corrente dell'investimento rispetto al valore corrente del portafoglio). **Emissioni totali di carbonio TCFD** - Le emissioni assolute di gas a effetto serra associate a un portafoglio, espresse in tonnellate di CO2e. Le emissioni di gas serra Scope 1 e Scope 2 sono assegnate agli emittenti in base a un approccio di proprietà azionaria. **Impronta di carbonio TCFD** - Emissioni totali di carbonio per un portafoglio normalizzato per il valore di mercato del portafoglio, espresso in tonnellate CO2e / mln USD investiti. Le emissioni di gas serra Scope 1 e Scope 2 sono assegnate agli investitori in base a un approccio di proprietà azionaria. **Intensità di carbonio TCFD** - Volume di emissioni di CO2 per milione di dollari di ricavi (efficienza in termini di un portafoglio), espresso in tonnellate CO2e / mln USD di ricavi. Le emissioni di gas serra Scope 1 e Scope 2 sono assegnate agli investitori in base a un approccio di proprietà azionaria. **Diversità di genere** Al momento utilizziamo il set di dati "People" di Factset per comunicare il numero di donne presenti nel consiglio di amministrazione di ciascuna società del portafoglio del Fondo. Dati e parametri sono stati ottenuti come segue, dai seguenti collaboratori, alla data della presente relazione e sono soggetti alle relative informative sotto riportate. Tutti gli altri dati sono stati ottenuti da SSGA. **Sezioni Trucost** intensità di carbonio (diretta+indiretta), intensità di carbonio media ponderata (diretta+indiretta), emissioni di carbonio di scope 1+2, totale emissioni di CO2 da riserve Trucost® è un marchio registrato di S&P Trucost Limited ("Trucost") ed è utilizzato in licenza. La Relazione ESG non è in alcun modo sponsorizzata, avallata, venduta o promossa da Trucost o dalle sue affiliate (insieme le "Parti

licenzianti") e nessuna delle Parti licenzianti esprime alcuna rivendicazione, previsione, garanzia o rappresentazione, in modo esplicito o implicito, sia per quanto riguarda (i) i risultati che sono ottenuti dall'utilizzo dei dati Trucost con la relazione, che per quanto riguarda (ii) l'idoneità dei dati Trucost per le finalità attinenti alla relazione. Nessuna delle Parti licenzianti fornisce alcuna raccomandazione o consulenza di natura finanziaria o d'investimento in riferimento alla presente relazione. Le Parti licenzianti non saranno responsabili (per negligenza o altri motivi) nei confronti di alcun soggetto per qualsivoglia errore nei dati Trucost né avranno alcun obbligo di avvertire alcun soggetto di detti errori. **Sezioni FactSet** diversità di genere La presente pubblicazione potrebbe contenere informazioni proprietarie di FactSet ("Informazioni di FactSet") che non possono essere riprodotte, utilizzate, divulgate, modificate o pubblicate in alcun modo senza previo consenso esplicito scritto di FactSet. Le Informazioni di FactSet sono fornite "così come sono" e tutte le dichiarazioni e garanzie, sia scritte che orali, esplicite o implicite (per legge, statuto o altro) sono nella presente escluse e negate, nella più ampia misura consentita dalla legge. In particolare, per quanto riguarda le Informazioni di FactSet, FactSet nega qualsiasi garanzia implicita di commerciabilità e idoneità per finalità particolari e non offre alcuna garanzia in materia di accuratezza, completezza, tempestività, funzionalità e/o affidabilità. Le Informazioni di FactSet non costituiscono una consulenza di investimento e qualsiasi opinione o affermazione contenuta in una pubblicazione riportante le Informazioni di FactSet (e/o le Informazioni di FactSet stesse) non rappresenta le opinioni o le convinzioni di FactSet, delle sue affiliate e/o entità connesse, e/o di qualsiasi loro dipendente. FactSet non è responsabile di alcun danno derivante dall'utilizzo, in qualsivoglia maniera, della presente pubblicazione o delle Informazioni di FactSet che potrebbero essere ivi contenute. © 2024 State Street Corporation. Tutti i diritti riservati. Data di scadenza: 30/04/2025