

# SPDR<sup>®</sup> Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG UCITS ETF (Acc)

Factsheet

28 Februari 2023

Duurzaamheid, sociaal en behoorlijk bestuur

## Fondsdoelstelling

De doelstelling van het Fonds is beleggers een totaalrendement te bieden, rekening houdend met zowel kapitaal- als inkomstenrendementen, dat doorgaans het rendement van de Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG Ex-Controversies Select Index weerspiegelt.

## Beschrijving van index

De index is een benchmark van kredietwaardige, vastrentende, in Amerikaanse dollar luidende obligaties met een optimale R-Factor<sup>™</sup>-score van State Street Global Advisors<sup>®</sup>. Voor de index worden effecten geselecteerd uit de Bloomberg Barclays US Corporate Bond Index en die worden gewogen op basis van een optimaliseringsproces, waarbij het totale actieve risico beperkt wordt. De index sluit emittenten uit op basis van bepaalde betrokkenheidscriteria en/of omdat ze niet voldoen aan de principes van het UN Global Compact.

## Belastingstatus

SSGA streeft ernaar te voldoen aan alle geldende eisen in verband met belastingaangifte voor SPDR ETF's in de volgende landen. Aanvragen worden het hele jaar door ingediend, afhankelijk van het door elke lokale belastingdienst voorgeschreven tijdschema: VK, Duitsland, Oostenrijk, Zwitserland.

## Landen van inschrijving

Zwitserland, Zweden, Verenigd Koninkrijk, Spanje, Oostenrijk, Noorwegen, Nederland, Luxemburg, Italië, Ierland, Frankrijk, Finland, Duitsland, Denemarken

## Noteringen

Beurs	Beurs-ticker	Handelsvaluta	iNAV ticker	Bloomberg code	Reuters code	SEDOL code
Deutsche Börse*	SPPU	EUR	INSPPU	SPPU GY	SPPU.DE	BMF5B33
London Stock Exchange	USCR	USD	INSPPUU	USCR LN	USCR.L	BMTVQG5
SIX Swiss Exchange	USCR	USD	INSPPU	USCR SE	USCR.S	BLF7VX2
Bolsa Mexicana de Valores	USCRN	MXN		USCRN MM	USCRN.MX	BLH17W3

\*Duidt op primaire beursnotering

## Fondsgegevens

ISIN	IE00BLF7VX27
Indexnaam	Bloomberg SASB US Corporate ESG Ex-Controversies Select Index
Index-ticker	I35146US
Type index	Totaalopbrengst
Aantal componenten	3.396

## Belangrijkste feiten

Aanvangsdatum	23-Okt-2020
Klasse valuta delen	USD
Fonds — Basisvaluta	USD
TER	0,15%
Behandeling van inkomsten	Accumulatie
Replicatiemethode	Gelaagde steekproef
Voldoet aan UCITS-richtlijn	Ja
SFDR-fondsclassificatie	SFDR - Artikel 8
Domicilie	Ierland
Beleggingsbeheerder	State Street Global Advisors Europe Limited
sub-beleggingsmanager	State Street Global Advisors Limited State Street Global Advisors Trust Company
Paraplufonds	SSGA SPDR ETFs Europe I plc
Activa in aandelen categorie (miljoen)	US\$6.361,69
Totaal activa in fonds (miljoen)	US\$6.646,17
Komt in aanmerking voor ISA	Ja
Komt in aanmerking voor SIPP	Ja
Komt in aanmerking voor PEA	Nee

<b>Rendement</b>					
	<b>Index</b>	<b>Fonds, bruto</b>	<b>Vershil</b>	<b>Fonds, netto</b>	<b>Vershil</b>
<b>Rendement op jaarbasis (%)</b>					
1 jaar	-10,49	-10,56	-0,07	-10,69	-0,20
3 jaar	-	-	-	-	-
5 jaar	-	-	-	-	-
10 jaar	-	-	-	-	-
Sinds aanvang	-6,06	-6,18	-0,13	-6,32	-0,27
<b>Cumulatief rendement (%)</b>					
1 maand	-3,14	-3,17	-0,03	-3,19	-0,04
3 maand	0,27	0,23	-0,04	0,19	-0,07
1 jaar	-10,49	-10,56	-0,07	-10,69	-0,20
2 jaar	-13,51	-13,63	-0,12	-13,88	-0,38
3 jaar	-	-	-	-	-
5 jaar	-	-	-	-	-
10 jaar	-	-	-	-	-
Sinds aanvang	-13,65	-13,92	-0,27	-14,22	-0,57
<b>Resultaat over kalenderperiode (%)</b>					
2023	0,71	0,69	-0,03	0,66	-0,05
2022	-15,82	-15,90	-0,08	-16,02	-0,20
2021	-0,97	-1,20	-0,24	-1,35	-0,38
2020	2,84	2,89	0,05	2,86	0,02

	<b>Fonds (%)</b>
<b>Standaarddeviatie (3 jaar)</b>	-
<b>Tracking-error op jaarbasis (3 jaar)</b>	-

In het verleden behaalde resultaten zijn geen indicatie voor toekomstige resultaten. In de vermelde prestatiegegevens is geen rekening gehouden met provisies en kosten in verband met de uitgifte en terugkoop van aandelen of de aankoop en verkoop van deelnemingsrechten. Indien het rendement is berekend op basis van intrinsieke waarden die niet luiden in de boekhoudkundige valuta van de instelling voor collectieve belegging, kan de waarde stijgen of dalen als gevolg van valutaschommelingen.

Wanneer het fonds volgens de officiële intrinsieke-waardekalender gesloten is, terwijl toch een aanzienlijk deel van de koersen van de onderliggende effecten kan worden bepaald, wordt een Technische Intrinsieke Waarde berekend. De in het verleden behaalde resultaten in dit document zijn dus zo nodig met behulp van een Technische Intrinsieke Waarde berekend, én met de officiële intrinsieke waarde van het fonds op elke andere werkdag in de betreffende periode.

Het rendement voor het kalenderjaar waarin het fonds is geïntroduceerd, betreft een deel van het jaar wanneer de introductiedatum van het betreffende fonds of het historische performance-linked fonds (welke zich het eerst voordoet) in de betreffende periode valt.

<b>Eigenschappen</b>	
Aantal posities	2.769
Gemiddelde maturiteit in jaren	10,92
Effectieve convexiteit	0,99%
Effectieve duur	7,11
Rendement tot einde looptijd	5,47%
*Distributierendement	-

\* Dit meet het in het verleden uitgekeerde dividendrendement per aandeel over 12 maanden, gedeeld door de IW.

Bron: SSGA De weergegeven kenmerken, deelnemingen, landenallocaties en sectoren zijn vanaf de datum vermeld bovenaan deze factsheet en zijn onderhevig aan wijzigingen. Elke verwijzing naar een specifiek bedrijf of effect vormt geen aanbeveling om rechtstreeks in een dergelijk bedrijf of effecten te kopen, verkopen, aan te houden of erin te investeren.

<b>Top 10 participaties</b>	<b>Weging (%)</b>
DEUTSCHE TELEKOM INT FIN 8.75 06/15/2030	0,80
CISCO SYSTEMS INC 5.5 01/15/2040	0,58
CISCO SYSTEMS INC 5.9 02/15/2039	0,54
NOVARTIS CAPITAL CORP 3.4 05/06/2024	0,52
NOVARTIS CAPITAL CORP 3 11/20/2025	0,45
TELEFONICA EMISIONES SAU 5.213 03/08/2047	0,43
BRITISH TELECOMMUNICATIO 9.625 12/15/2030	0,38
TORONTO-DOMINION BANK 3.625 09/15/2031	0,38
SALESFORCE INC 3.7 04/11/2028	0,37
LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.65 03/24/2026	0,34

<b>Verdeling naar kredietkwaliteit</b>	<b>Weging (%)</b>
Aaa	1,48
Aa	8,37
A	44,14
Baa	45,94
Geen rating	0,06

De kredietkwaliteitsbeoordeling is gebaseerd op een gemiddelde van Moody's, S&P en Fitch.

<b>Verdeling naar sector</b>	<b>Weging (%)</b>
Bedrijven - Industrieel	60,38
Bedrijven - Financieel	33,81
Bedrijven - Nutsbedrijven	5,85

<b>Verdeling naar vervaldatum</b>	<b>Weging (%)</b>
0 - 1 jaar	-0,04
1 - 3 jaar	21,96
3 - 5 jaar	16,89
5 - 7 jaar	9,69
7 - 10 jaar	16,38
10 - 20 jaar	14,14
> 20 jaar	20,98

**Kapitaalrisico: Beleggen brengt het risico van kapitaalverlies met zich mee. In het verleden behaalde rendementen zijn geen betrouwbare indicator van toekomstige rendementen.**

Grootste weging per land	Weging (%)
Verenigde Staten	69,03
Verenigd Koninkrijk	10,90
Canada	6,98
Zwitserland	2,60
Spanje	2,20
Australië	1,93
Duitsland	1,40
België	1,38
Nederland	1,05
Frankrijk	1,01
Japan	0,43
Chili	0,40
Bermuda	0,20
China	0,19
Taiwan	0,16
Luxemburg	0,10
Mexico	0,03
Italië	0,01

## ssga.com/etfs

### Risicofactoren

Het fonds heeft een risico- en opbrengstprofiel van categorie 4, aangezien het rendement in het verleden middelmatige stijgingen en dalingen heeft gekend.

Hieronder volgen materiële risico's die relevant zijn voor het Fonds en die niet voldoende worden gedekt door de risicocategorie.

#### Concentratierisico

#### Risico op het volgen van de index

#### Liquiditeitsrisico & ETF-liquiditeitsrisico

#### Risico in verband met aandelencategorieën

#### Screeningsrisico

Lees het prospectus en de KIID's voor meer informatie over de risico's.

### Woordenlijst

**Effectieve convexiteit** Een maatstaf van de kromming in de relatie tussen obligatiekoersen en obligatierentes die aangeeft hoe de duration van een obligatie verandert wanneer de rente verandert.

**Effectieve duration** Een duration-berekening voor obligaties die daarin besloten opties (ingebodde opties) bevatten. Deze maatstaf van duration houdt rekening met het feit dat de verwachte kasstromen schommelen wanneer de rente verandert. De effectieve duration kan worden geschat met behulp van de modified duration als een obligatie met ingebodde opties zich gedraagt als een obligatie zonder opties.

**Rendement tot einde looptijd** Het verwachte totaalrendement van een obligatie als deze tot aan de vervaldatum wordt aangehouden. Het effectieve rendement wordt beschouwd als de obligatierente op lange termijn maar wordt uitgedrukt als een jaarlijks percentage. Anders gezegd, het is het intern rendement (IRR) van een obligatiebelegging als de belegger de obligatie tot aan de vervaldatum aanhoudt en als alle betalingen volgens schema verlopen.

**Distributierendement** Het jaarlijks dividend per aandeel van het fonds gedeeld door de koers van het fonds.

**Delta** Een maatstaf van de aandelengevoeligheid die de relatie weergeeft tussen een procentuele verandering in de aandelenkoers en de daarmee overeenkomende verwachte procentuele verandering in de koers van de converteerbare obligatie. Dit wordt ook

wel prijselasticiteit genoemd.

**TER** De Total Expense Ratio is de vergoeding die het fonds betaalt, uitgedrukt als percentage van de intrinsieke waarde, om de kosten te dekken in verband met de exploitatie en het beheer van de activaportefeuille.

#### Uitsluitend voor professionele cliënten / gekwalificeerde beleggers. Niet voor openbare distributie.

Beursgenoteerde fondsen (Exchange Traded Funds - ETF's) worden verhandeld zoals aandelen, zijn onderhevig aan beleggingsrisico's en zullen fluctueren in marktwaarde. De waarde van de belegging kan zowel dalen als stijgen en het rendement op de belegging zal bijgevolg variabel zijn. De wijzigingen in wisselkoersen kunnen een nadelig effect hebben op de waarde, prijs of inkomsten van een belegging. Verder is er geen garantie dat een ETF zijn beleggingsdoelstellingen zal behalen.

#### Marketingcommunicatie

SPDR ETF's zijn mogelijk niet beschikbaar of geschikt voor u. De gegeven informatie is geen beleggingsadvies zoals gedefinieerd in de Richtlijn betreffende markten voor financiële instrumenten (2014/65/EU, "MiFID") en dient niet als zodanig te worden beschouwd. De informatie dient niet te worden beschouwd als een uitnodiging om een belegging te kopen of te verkopen. De informatie houdt geen rekening met bepaalde beleggingsdoelstellingen, strategieën, fiscale status, risicobereidheid of beleggingshorizon van een (potentiële) belegger. Als u beleggingsadvies nodig hebt, dient u uw belasting- en financiële of een andere professionele adviseur te raadplegen. De fiscale behandeling hangt af van de individuele omstandigheden van elke cliënt en kan in de toekomst veranderen.

Dit document vormt geen aanbod of verzoek om aandelen in SPDR ETF's Europe I plc en SPDR ETF's Europe II plc te kopen.

**Lees het prospectus en de meest recente document met essentiële beleggersinformatie (ebi) van het Fonds vóór u een beleggingsbeslissing neemt. De meest recente Engelse versie van het Prospectus en de ebi zijn te vinden op [www.ssga.com](http://www.ssga.com). Een samenvatting van de rechten van beleggers vindt u hier: <https://www.ssga.com/library-content/products/fund-docs/summary-of-investor-rights/ssga-spd-investors-rights-summary.pdf> Merk op dat de beheermaatschappij kan besluiten de getroffen regelingen voor het**

## Neem contact op

Bezoek onze website op [ssga.com/etfs](http://ssga.com/etfs) of contact je lokale SPDR ETF contactpersoon. Het is ook mogelijk om een e-mail te sturen naar [spdrseurope@ssga.com](mailto:spdrseurope@ssga.com).

### Frankrijk & Luxemburg

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

### Italië

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

### Scandinavië

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

### Zwitserland

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

### Duitsland

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

### Nederland

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

### Spanje

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

### Verenigd Koninkrijk

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

### in de handel brengen te beëindigen en over te gaan tot de-notificatie overeenkomstig artikel 93a van Richtlijn 2009/65/EG.

Alle documenten die betrekking hebben op het fonds, zijn kosteloos verkrijgbaar ten kantore van de Plaatselijke Vertegenwoordiger/Agent, via [www.ssga.com](http://www.ssga.com) of door contact op te nemen met State Street Custodial Services (Ireland) Limited, 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, Ierland.

SPDR ETF's is het platform voor beursgenoteerde fondsen ("ETF") van State Street Global Advisors en bestaat uit fondsen die door de Central Bank of Ireland zijn erkend als beleggingsvennootschappen met veranderlijk kapitaal.

De fondsen zijn niet beschikbaar voor Amerikaanse beleggers. SSGA SPDR ETF's Europe I plc en SPDR ETF's Europe II plc ("de Vennootschap") geven SPDR ETF's uit en zijn open-end beleggingsmaatschappijen met variabel kapitaal met gescheiden aansprakelijkheid tussen de subfondsen. De Vennootschap is opgezet als een Instelling voor Collectieve Belegging in Effecten (jobe) naar Iers recht en is toegelaten als een icbe door de Central Bank of Ireland.

#### Aanvullende belangrijke informatie:

**In het VK** is dit document uitgegeven door State Street Global Advisors Limited ("SSGA"). Vergunning verleend door en onder toezicht van de Britse Financial Conduct Authority, ingeschreven onder nr. 2509928. Btw-nr. 5776591 81. Statutaire zetel: 20 Churchill Place, Canary Wharf, Londen, E14 5HJ, Verenigd Koninkrijk Telefoon: 020 3395 6000 Fax: 020 3395 6350 Website: [www.ssga.com](http://www.ssga.com).

**In de EU** is dit document uitgegeven door State Street Global Advisors Europe Limited ("SSGA"), die onder toezicht staat van de Centrale Bank van Ierland. Statutaire zetel: 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, Ierland. Inschrijvingsnummer 49934. T: +353 (0)1 776 3000. Fax: +353 (0)1 776 3300. Website: [www.ssga.com](http://www.ssga.com).

#### Plaatselijke Vertegenwoordiger/ Betaalkantoren van SPDR ETF's:

**Frankrijk:** State Street Bank International GmbH Paris Branch, Cœur Défense - Tour A, 100, Esplanade du Général de Gaulle, 92931 Paris La Defense Cedex; **Zwitserland:** State Street Bank GmbH Munich, Zurich Branch, Beethovenstrasse 19, 8027 Zürich en de hoofddistributeur in Zwitserland, State Street Global Advisors AG, Beethovenstrasse 19, 8027 Zürich; **Duitsland:** State Street Global Advisors Europe Limited, Briener Strasse 59, D-80333

München; **Spanje:** Cecabank, S.A. Alcalá 27, 28014 Madrid; **Denemarken:** Nordea Bank Denmark A/S, Issuer Services, Securities Services Hermes Hus, Helgeshøj Allé 33 Postbox 850 DK-0900 Kopenhagen C; **Oostenrijk:** Erste Bank, Graben 21, 1010 Wenen; **Zweden:** SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB, Global Transaction Services ST MHI, SE-106 40 Stockholm.

Bloomberg en alle Bloomberg-indexen zijn dienstmerken van Bloomberg Finance L.P. en zijn gelieerde ondernemingen, waaronder Bloomberg Index Services Limited ("BISL"), de beheerder van de index (gezamenlijk, "Bloomberg") en zijn voor gebruik voor bepaalde doeleinden in licentie gegeven door State Street Bank and Trust Company, via zijn divisie State Street Global Advisors ("SSGA"). Bloomberg is niet verbonden aan SSGA en Bloomberg keurt geen SSGA-product goed, bekrachtigt het niet, beoordeelt het niet en beveelt het niet aan.

Bloomberg staat niet in voor de tijdigheid, juistheid of volledigheid van gegevens of informatie met betrekking tot elk SSGA-product. Standard & Poor's, S&P en SPDR zijn geëdeponerde handelsmerken van Standard & Poor's Financial Services LLC (S&P); Dow Jones is een geëdeponerd handelsmerk van Dow Jones Trademark Holdings LLC (Dow Jones); en deze handelsmerken zijn in licentie gegeven voor gebruik door S&P Dow Jones Indices LLC (SPDJI) en in sublicentie gegeven voor gebruik voor bepaalde doeleinden door State Street Corporation. De financiële producten van State Street Corporation worden niet gesponsord, aanbevolen, verkocht of gepromoot door SPDJI, Dow Jones, S&P, de respectieve verbonden ondernemingen en externe licentiegevers en geen van deze partijen geeft enige verklaring met betrekking tot de wenselijkheid van beleggen in dit product of deze producten of heeft enige aansprakelijkheid in verband hiermee, met inbegrip van eventuele fouten, omissies of onderbrekingen in enige index.

De hierin genoemde handelsmerken en servicemerken zijn eigendom van de respectievelijke eigenaren. Externe dataproviders geven geen enkele verklaring of garantie met betrekking tot de juistheid, volledigheid of tijdigheid van de gegevens en zijn in geen geval aansprakelijk voor enige schade in verband met het gebruik van deze gegevens.

Zonder uitdrukkelijke schriftelijke toestemming van SSGA mag dit document niet geheel of gedeeltelijk worden gereproduceerd, gekopieerd of verzonden en mag de inhoud niet aan derden bekend worden gemaakt.

## R-Factor™-overzicht

R-Factor™ is gebaseerd op een transparante classificatiemethodologie die gebruik maakt van de Materiality Map van de Sustainability Accounting Standards Board (SASB), gedragscodes op het gebied van corporate governance, en data van onze vier best-in-class leveranciers van ESG-informatie. R-Factor ondersteunt de ontwikkeling van duurzame kapitaalmarkten door beleggers de mogelijkheid te geven om te beleggen in oplossingen die financieel materiële ESG-informatie integreren en tegelijkertijd bedrijven stimuleren om hun ESG-praktijken en transparantie te verbeteren op de terreinen die van wezenlijk belang zijn.

De gegevens in de ESG-secties van deze factsheet zijn de meest recente die beschikbaar zijn en hebben een vertraging van één maand ten opzichte van de rapportagedatum.

Bron: Factset/SSGA. Holdings per 28 Feb 2023, R-Factor data per 31 Jan 2023.

## R-Factor-profiel van het fonds

Niet beschikbaar	0,19%
Achterblijver	0,00%
Lagere score	0,00%
Gemiddelde score	0,00%
Hogere score	0,68%
Hoogste score	99,13%

Bron: Factset/SSGA per 31 Jan 2023.

## R-Factor

R-Factor-overzicht	Fonds
R-Factor	79

Bron: Factset/SSGA per 31 Jan 2023.

Dekking van het fonds	Aantal	Percentage van totaal aantal effecten (%)	Percentage van totale marktwaarde (%)
Effecten opgenomen in R-Factor-analyse	2.757	99,64	99,81
Totaal aantal effecten in het fonds	2.767		

Bron: Factset/SSGA per 31 Jan 2023.

Top 10-posities	Fondsweging (%)	R-Factor-score
JPMorgan Chase & Co	4,07	78
Apple Inc	2,80	91
Morgan Stanley	2,58	76
Lloyds Banking Group PLC	2,26	80
Bank of Montreal	2,21	83
Novartis Capital Corp	2,20	90
HP Inc	2,15	100
AT&T Inc	2,09	78
Boston Properties LP	2,06	83
Cisco Systems Inc	1,98	100

### 5 hoogste R-Factor-scores

Cisco Systems Inc	1,98	100
HP Inc	2,15	100
Lafarge SA	0,07	92
Apple Inc	2,80	91
Enel Americas SA	0,13	91

### 5 laagste R-Factor-scores

NextEra Energy Capital Holdings Inc	0,07	68
Duke Energy Carolinas LLC	0,03	68
Duke Energy Corp	0,12	68
Duke Energy Progress LLC	0,03	68
Piedmont Natural Gas Co Inc	0,02	68

Bron: Factset/SSGA per 31 Jan 2023.

Het R-Factor-overzicht heeft uitsluitend betrekking op bepaalde ESG-kenmerken en is geen weergave van de performance van het fonds. Zie onder 'Belangrijke informatie' voor aanvullende gegevens en definities van de gepresenteerde ESG-maatstaven.

## ssga.com/etfs

**R-Factor™** R-Factor™ is een ESG-scoresysteem dat gebruikmaakt van algemeen geaccepteerde materialiteitskaders die worden ondersteund door een grote groep ondernemingen en beleggers voor het genereren van een unieke ESG-score voor beursgenoteerde bedrijven. De score is gebaseerd op ESG-gegevens van vier afzonderlijke providers (Sustainalytics, ISS-Oekom, Vigeo-EIRIS en ISS-Governance) teneinde de totale dekking te verbeteren en de inherente vertekening van de bestaande scoremethodologieën te verwijderen. R-Factor™ is ontworpen om bedrijven meer controle te geven over het creëren van duurzame markten. **R-Factor™-scores** uit verschillende sectoren kunnen onderling worden vergeleken. De ESG- en Corporate Governance (CorpGov)-scores zijn zo ontworpen dat ze gebaseerd zijn op de

factoren die van essentieel belang zijn voor de sector en het regelgevingsgebied van een bedrijf. Een uniforme beoordelingsschaal maakt het mogelijk om de eindscores van bedrijven met elkaar te vergelijken.

**Het R-Factor™** beoordelingsproces omvat twee componenten. De eerste component is gebaseerd op het kader dat is gepubliceerd door de Sustainability Accounting Standards Board (SASB). Dit kader wordt gebruikt voor alle ESG-aspecten van de score die geen betrekking hebben op corporate governance. Het SASB-kader identificeert de ESG-risico's die financieel van wezenlijk belang zijn voor de emittent, op basis van de sectorclassificatie. Deze component van de R-Factor™-score wordt uitsluitend bepaald door de ESG-cijfers van de ESG-dataproviders die specifiek betrekking hebben op de ESG-risico's die door het SASB-kader zijn geïdentificeerd als financieel belangrijk voor de emittent op basis van de

sectorclassificatie.

De tweede component van de score, de CorpGov-score, wordt gegenereerd op basis van regio-specifieke corporategovernancecodes, die door beleggers of toezichhouders zijn ontwikkeld. Deze governancecodes beschrijven de minimale verwachtingen ten aanzien van corporate governance in een specifieke regio. Ze beslaan doorgaans onderwerpen zoals aandeelhoudersrechten, onafhankelijkheid van de raad van bestuur en de vergoeding van directieleden. Deze component van de R-Factor™ maakt gebruik van door ISS-Governance verstrekte gegevens om een CorpGov-score aan een emittent toe te wijzen aan de hand van deze governancecodes.

**R-Factor™-profiel** Binnen elke sector worden emittenten in vijf verschillende ESG-prestatiegroepen ingedeeld, op basis van het percentiel waarin hun R-Factor™-scores vallen. Door de R-Factor™-score van het bedrijf met een

bandbreedte te vergelijken wordt een bedrijf in een van de vijf ESG-prestatieklassen ingedeeld: Laggard (10% van het universum), Underperformer (20% van het universum), Average Performer (40% van het universum), Outperformer (20% van het universum) of Leader (10% van het universum). De R-Factor™-scores zijn normaal verdeeld op basis van genormaliseerde waarden op een puntenschaal van 0-100.

Voor voorbeelden van informatie over de R-Factor in begrijpelijke taal, leest u onderstaande ELR-registratieverklaring: <https://www.sec.gov/Archives/edgar/data/1107414/00011931251912334/d774617d497.htm>

© 2023 State Street Corporation.  
Alle rechten voorbehouden.  
Vervaldatum: 29/02/2024