

SPDR[®] Bloomberg SASB U.S. Corporate ESG EUR Hdg UCITS ETF

Factsheet

31 Mei 2022

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. Het fonds is geclassificeerd als een artikel 8-fonds onder SFDR.

Beschrijving van index

De Bloomberg SASB US Corporate ESG Ex-Controversies Select Index (EUR Hedged) vertegenwoordigt een nauwkeurige schatting van het rendement dat kan worden behaald door de valutablootstelling van de moederindex, de Bloomberg SASB US Corporate ESG Ex-Controversies Select Index, af te dekken naar EUR. De index is 100% afgedekt naar de EUR door de valuta van de moederindex op termijn te verkopen tegen de 1-month forward rate.

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

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
Euronext Amsterdam*	USCE	EUR	INUSCE	USCE NA	USCE.AS	BMCD8H3
Borsa Italiana	USCE	EUR	INUSCE	USCE IM	USCE.MI	BMCD8K6

*Duidt op primaire beursnotering

Fondsgegevens

ISIN	IE00BFY0GV36
Indexnaam	Bloomberg SASB US Corporate ESG Ex-Controversies Select Index (EUR Hedged)
Index-ticker	H35146EU
Type index	Totaalopbrengst
Aantal componenten	3.235

Belangrijkste feiten

Aanvangsdatum	11-Jun-2021
Klasse valuta delen	EUR
Fonds — Basisvaluta	USD
TER	0,20%
Behandeling van inkomsten	Accumulatie
Replicatiemethode	Gelaagde steekproef
Voldoet aan UCITS-richtlijn	Ja
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 aandelencategorie (miljoen)	€239,02
Totaal activa in fonds (miljoen)	US\$6.562,98
Komt in aanmerking voor ISA	Ja
Komt in aanmerking voor SIPP	Ja
Komt in aanmerking voor PEA	Nee
Currency Hedging	Maandelijks

Er worden geen resultaten weergegeven voor het fonds omdat het minder dan 12 maanden geleden is geïntroduceerd.

Eigenschappen

Aantal posities	2.523
Gemiddelde maturiteit in jaren	11,51
Effectieve convexiteit	1,16%
Effectieve duur	7,83
Rendement tot einde looptijd	4,14%

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.

Top 10 participaties	Weging (%)
DEUTSCHE TELEKOM INT FIN 8.75 06/15/2030	0,81
BRITISH TELECOMMUNICATIO 9.625 12/15/2030	0,64
CISCO SYSTEMS INC 5.5 01/15/2040	0,64
CISCO SYSTEMS INC 5.9 02/15/2039	0,60
NOVARTIS CAPITAL CORP 3.4 05/06/2024	0,41
AXA SA 8.6 12/15/2030	0,39
SALESFORCE INC 3.7 04/11/2028	0,39
TORONTO-DOMINION BANK 3.625 09/15/2031	0,36
TELEFONICA EMISIONES SAU 5.213 03/08/2047	0,36
LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.65 03/24/2026	0,35

Verdeling naar kredietkwaliteit	Weging (%)
Aaa	2,08
Aa	7,02
A	44,09
Baa	46,65
Geen rating	0,16

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

Verdeling naar sector	Weging (%)
Bedrijven - Industrieel	59,77
Bedrijven - Financieel	33,66
Bedrijven - Nutsbedrijven	6,21
Liquide middelen/Contante middelen/Cash	0,36

Verdeling naar vervaldatum	Weging (%)
0 - 1 jaar	0,36
1 - 3 jaar	18,07
3 - 5 jaar	18,19
5 - 7 jaar	8,89
7 - 10 jaar	16,66
10 - 20 jaar	14,68
> 20 jaar	23,14

Grootste weging per land	Weging (%)
Verenigde Staten	70,38
Verenigd Koninkrijk	11,04
Canada	6,49
Australië	1,90
Frankrijk	1,68
België	1,47
Spanje	1,47
Duitsland	1,33
Zwitserland	1,25
Nederland	1,08
Chili	0,40
Japan	0,38
Bermuda	0,34
China	0,30
Taiwan	0,16
Italië	0,16
Macau	0,06
Mexico	0,06
Luxemburg	0,05
Zuid-Afrika	0,02

Neem contact op

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

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

Duitsland
spdrsgermany@ssga.com
 +49 69 66774 5016

Italië
spdretf_italia@ssga.com
 +39 0232066 140

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

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

Spanje
spdrseurope@ssga.com
 +39 0232066 140

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

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

Kapitaalrisico: Beleggen brengt het risico van kapitaalverlies met zich mee. In het verleden behaalde resultaten vormen geen garantie voor de toekomst.

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, risicoobereidheid 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.

Raadpleeg het meest recente document met essentiële beleggersinformatie en het Prospectus van het Fonds voordat u een definitieve beleggingsbeslissing neemt. De meest recente Engelse versie van het prospectus en de Nederlandse KIID is te vinden op 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-spdri-investors-rights-summary.pdf> Merk op dat de beheermaatschappij kan besluiten de getroffen regelingen voor het 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 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 (icbe) 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.

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.

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, Brienner 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 Copenhagen C; **Oostenrijk:** Erste Bank, Graben 21, 1010 Wenen; **Zweden:** SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN

AB, Global Transaction Services ST MHI, SE-106 40 Stockholm.

Het fonds/de aandelencategorie kan gebruik maken van financiële derivaten voor valuta-afdekking en efficiënt beheer van de portefeuille. Het fonds kan effecten aankopen die niet luiden in de valuta van de aandelencategorie. Afdekking zou de effecten van wisselkoersschommelingen moeten verminderen, maar de afdekking kan soms niet perfect aansluiten, waardoor verliezen kunnen ontstaan.

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 gedeponeerde handelsmerken van Standard & Poor's Financial Services LLC (S&P); Dow Jones is een gedeponeerd 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 (SPDJ) en in publiciteit 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 SPDJ, 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 verspreid 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 31 Mei 2022, R-Factor data per 30 Apr 2022.

R-Factor-profiel van het fonds

Niet beschikbaar	0,09%
Achterblijver	0,00%
Lagere score	0,00%
Gemiddelde score	0,00%
Hogere score	5,20%
Hoogste score	94,70%

Bron: Factset/SSGA per 30 Apr 2022.

R-Factor

R-Factor-overzicht	Fonds
R-Factor	79

Bron: Factset/SSGA per 30 Apr 2022.

Dekking van het fonds	Aantal	Percentage van totaal aantal effecten (%)	Percentage van totale marktwaarde (%)
Effecten opgenomen in R-Factor-analyse	2.517	99,84	99,91
Totaal aantal effecten in het fonds	2.521		

Bron: Factset/SSGA per 30 Apr 2022.

Top 10-posities	Fondsweging (%)	R-Factor-score
JPMorgan Chase & Co	4,08	79
Apple Inc	3,32	93
Morgan Stanley	2,39	80
Cisco Systems Inc	2,17	100
Boston Properties LP	2,11	77
Lloyds Banking Group PLC	2,09	80
Bank of America Corp	2,02	67
Verizon Communications Inc	2,01	81
AT&T Inc	2,00	77
Bank of Montreal	1,96	82

5 hoogste R-Factor-scores	Fondsweging (%)	R-Factor-score
HP Inc	1,87	100
Cisco Systems Inc	2,17	100
AXA SA	0,40	95
XLIT Ltd	0,34	95
Apple Inc	3,32	93

5 laagste R-Factor-scores	Fondsweging (%)	R-Factor-score
Cigna Corp	0,15	65
Amazon.com Inc	0,01	66
Sysco Corp	0,02	66
Bank of America Corp	2,02	67
NextEra Energy Capital Holdings Inc	0,03	67

Bron: Factset/SSGA per 30 Apr 2022.

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 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 corporate governance-codes, die door beleggers of toezichthouders zijn ontwikkeld. Deze governance-codes 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 governance-codes.

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-prestatielassen 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>

© 2022 State Street Corporation.
Alle rechten voorbehouden.
Vervaldatum: 31/05/2023