

SPDR® STOXX Europe 600 SRI UCITS ETF (Acc)

Factsheet

28 Februari 2023

Duurzaamheid, sociaal en behoorlijk bestuur

★★★★

Morningstar Rating™

31 Januari 2023

Fondsdoelstelling

De beleggingsdoelstelling van het fonds is het rendement van Europese aandelen te volgen.

Beschrijving van index

De STOXX® Europe 600 SRI-index volgt de performance van de STOXX® Europe 600 Index nadat een ESG-screening op uitstootintensiteit, naleving en betrokkenheid is toegepast. Bedrijven die qua uitstoot-intensiteit tot de hoogste 10% behoren, komen niet voor selectie in aanmerking. Bedrijven worden uitgesloten op basis van hun betrokkenheid bij bepaalde controversiële bedrijfsactiviteiten. De overige effecten zijn gerangschikt in aflopende volgorde van hun ESG-scores binnen elk van de 11 ICB Industry-groepen. De STOXX® Europe 600 SRI Index selecteert de best gerangschikte effecten in alle ICB Industrieën totdat het aantal geselecteerde effecten een derde van het aantal effecten in de onderliggende index bereikt.

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*	ZPDX	EUR	INZPDX	ZPDX GY	ZPDX.DE	BK9HD91
Euronext Amsterdam	600X	EUR	INZPDX	600X NA	600X.AS	BK5H801
Borsa Italiana	600X	EUR	INZPDX	600X IM	600X.MI	BK9HDB3
SIX Swiss Exchange	600X	EUR		600X SE	600X.S	BK9HDC4

*Duidt op primaire beursnotering

Fondsgegevens

ISIN	IE00BK5H8015
Indexnaam	STOXX Europe 600 SRI Index
Index-ticker	SXXRSRI
Type index	Netto totaalopbrengst
Aantal componenten	199

Belangrijkste feiten

Aanvangsdatum	30-Sep-2019
Klasse valuta delen	EUR
Fonds — Basisvaluta	EUR
TER	0,12%
Behandeling van inkomsten	Accumulatie
Replicatiemethode	Gerepliceerd
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
Paraplufonds	SSGA SPDR ETFs Europe II plc
Activa in aandelen categorie (miljoen)	€138,13
Totaal activa in fonds (miljoen)	€138,13
Komt in aanmerking voor ISA	Ja
Komt in aanmerking voor SIPP	Ja
Komt in aanmerking voor PEA	Nee

Vóór 1 december 2021 heette het fonds SPDR® STOXX Europe 600 ESG Screened UCITS ETF (Acc) en volgde het de STOXX Europe 600 ESG-X Index.

Rendement					
	Index	Fonds, bruto	Vershil	Fonds, netto	Vershil
Rendement op jaarbasis (%)					
1 jaar	3,86	4,17	0,32	4,05	0,19
3 jaar	9,09	9,35	0,26	9,21	0,12
5 jaar	-	-	-	-	-
10 jaar	-	-	-	-	-
Sinds aanvang	6,69	6,92	0,23	6,79	0,10
Cumulatief rendement (%)					
1 maand	0,93	0,94	0,01	0,93	0,00
3 maand	4,67	4,69	0,02	4,66	-0,01
1 jaar	3,86	4,17	0,32	4,05	0,19
2 jaar	17,74	18,47	0,72	18,18	0,44
3 jaar	29,80	30,71	0,91	30,24	0,45
5 jaar	-	-	-	-	-
10 jaar	-	-	-	-	-
Sinds aanvang	24,75	25,67	0,93	25,16	0,41
Resultaat over kalenderperiode (%)					
2023	8,29	8,32	0,02	8,29	0,00
2022	-11,81	-11,58	0,22	-11,69	0,12
2021	25,43	25,90	0,47	25,75	0,32
2020	-1,86	-1,81	0,05	-1,93	-0,07
2019	6,11	6,15	0,04	6,11	0,01

	Fonds (%)
Standaarddeviatie (3 jaar)	17,94
Tracking-error op jaarbasis (3 jaar)	0,17

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.

Eigenschappen	
Aantal posities	200
*Distributierendement	-
Koers/winstverhouding boekjaar 1	14,05
Gemiddelde koers/boekwaarde	2,15
Gemiddelde marktkapitalisatie (M)	€92.316,21
Dividendrendement index	3,07%

* 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.

Top 10 participaties	Weging (%)
NESTLE SA-REG	6,59
ASML HOLDING NV	5,28
NOVO NORDISK A/S-B	4,93
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	4,31
NOVARTIS AG-REG	4,00
UNILEVER PLC	2,79
SAP SE	2,45
SIEMENS AG-REG	2,38
SANOFI	2,29
L OREAL	2,05

Verdeling naar sector	Weging (%)
Gezondheidszorg	21,00
Financiële instellingen	20,45
Industrie	14,09
Niet-duurzame consumptiegoederen	13,39
Duurzame consumptiegoederen	11,64
Technologie	9,96
Telecommunicatie	3,93
Basismaterialen	2,54
Vastgoed	1,35
Nutsbedrijven	1,02
Energie	0,65

Met ingang van 22 maart 2021 is de indexprovider overgestapt op het nieuwe ICB-raamwerk. De wijzigingen omvatten: het hernoemen van de olie- en gasindustrie in 'Energie', het uitbreken van 'onroerend goed' uit de 'financiële' industrie en het creëren van een 11e bedrijfstak met de naam 'onroerend goed', en het opnieuw classificeren van 'consumptiegoederen' en Dienstensectoren als "Duurzame consumptiegoederen" en "Niet-duurzame consumptiegoederen". De Industry Classification Benchmark (ICB) is een taxonomie van de industrie-classificatie die wordt gebruikt door FTSE International en STOXX.

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 (%)
Zwitserland	22,21
Duitsland	18,00
Frankrijk	14,83
Verenigd Koninkrijk	12,80
Nederland	9,30
Denemarken	7,15
Italië	4,35
Zweden	3,79
Spanje	2,66
Finland	2,20
België	1,04
Noorwegen	0,87
Ierland	0,48
Portugal	0,10
Overige	0,22

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

Italië

spdretf_italia@ssga.com
+39 0232066 140

Scandinavië

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

Zwitserland

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

Duitsland

spdrsgermany@ssga.com
+49 69 66774 5016

Nederland

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

Spanje

spdrseurope@ssga.com
+39 0232066 140

Verenigd Koninkrijk

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

ssga.com/etfs

Risicofactoren

Het fonds heeft een risico- en opbrengstprofiel van categorie 6, 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 met betrekking tot index tracking

Liquideitsrisico en ETF-liquideitsrisico

Risico in verband met screening

SFDR - Fund Classification Risk

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

Woordenlijst

Koers-winstverhouding boekjaar 1 De gemiddelde koers van elk onderliggende effect gedeeld door de gemiddelde geschatte winst per aandeel voor het effect voor het volgende boekjaar waarvoor nog geen verslag is opgesteld, per de verslagdatum.

Gemiddelde koers-boekwaardeverhouding De gemiddelde koers van elk onderliggende effect gedeeld door de boekwaarde per aandeel voor het effect, per de verslagdatum.

Dividendrendement van de index Het gemiddelde van de jaarlijkse dividenden per aandeel van elk onderliggend effect in de index per de verslagdatum, gedeeld door de koers van het effect per de verslagdatum.

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.

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. Een samenvatting van de rechten van beleggers vindt u hier: <https://www.ssga.com/library-content/products/fund-docs/summary-of-investor-rights/ssga-spdr-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.

Aanvallende 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 ("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 Kopenhagen C; **Oostenrijk:** Erste Bank, Graben 21, 1010 Wenen; **Zweden:** SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB, Global Transaction Services ST MHI, SE-106 40 Stockholm.

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 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 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 hier 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.

Het is de ontvanger uitsluitend toegestaan de Indexgegevens te ontvangen of te bekijken in de vorm waarin deze gegevens worden weergegeven. De ontvanger begrijpt, erkent en stemt ermee in dat het gebruik van de Indexgegevens voor eigen risico is. De ontvanger begrijpt, erkent en stemt ermee in dat de Indexgegevens worden aangeleverd zoals ze zijn en dat noch Morningstar UK Limited (Morningstar) noch een van de contentleveranciers van Morningstar de juistheid, volledigheid, het niet schenden van enig recht, oorspronkelijkheid, tijdigheid of andere kenmerken van de Indexgegevens garanderen. De ontvanger begrijpt, erkent en stemt er daarnaast mee in dat de Indexgegevens uitsluitend worden geleverd aan u als belegger in financiële producten vanuit regelgevende vereisten en voor informatieve doeleinden. De Indexgegevens mogen niet door u worden gebruikt voor commerciële doeleinden en mogen niet worden gebruikt voor het handelen of andere doeleinden zonder dat er sprake is van een inschrijving op dergelijke Indexgegevens bij Morningstar.

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	0,00%
Achterblijver	0,00%
Lagere score	0,00%
Gemiddelde score	3,93%
Hogere score	8,84%
Hoogste score	87,23%

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	200	100,00	100,00
Totaal aantal effecten in het fonds	200		

Bron: Factset/SSGA per 31 Jan 2023.

Top 10-posities	Fondsweging (%)	R-Factor-score
Nestle S.A.	6,59	85
ASML Holding NV	5,28	81
Novo Nordisk A/S Class B	4,93	76
Roche Holding Ltd Dividend Right Cert.	4,31	72
Novartis AG	4,00	90
Unilever PLC	2,79	86
SAP SE	2,45	90
Siemens Aktiengesellschaft	2,38	79
Sanofi	2,29	90
L'Oreal S.A.	2,05	97

5 hoogste R-Factor-scores

Danone SA	0,77	100
Teleperformance SA	0,31	99
L'Oreal S.A.	2,05	97
Capgemini SE	0,68	95
Covivio SA	0,06	94

5 laagste R-Factor-scores

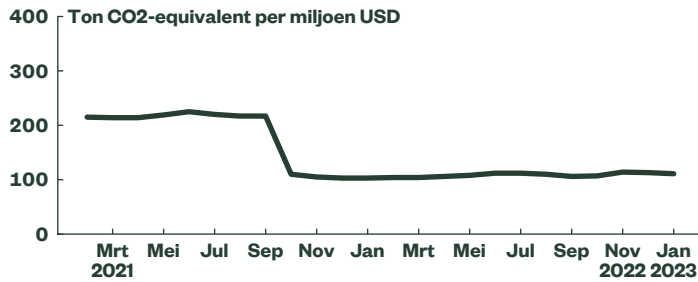
NEL ASA	0,05	46
Fuchs Petrolub SE Pref	0,08	47
Encavis AG	0,05	49
Victrex plc	0,06	51
Indutrade AB	0,13	54

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.

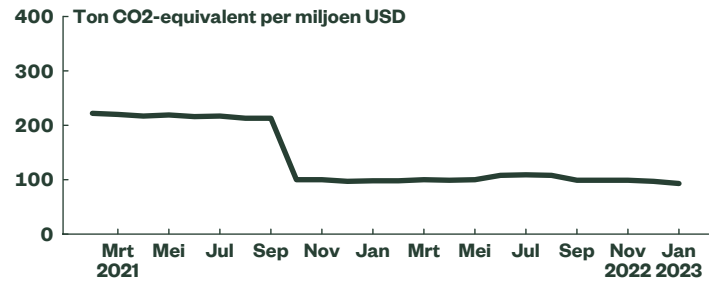
Klimaatprofiel

CO2-intensiteit



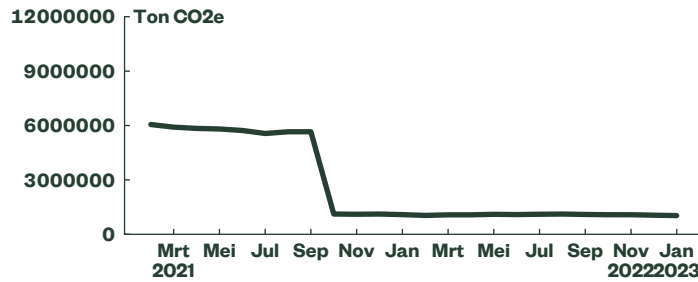
Fonds

Gewogen gemiddelde CO2-intensiteit



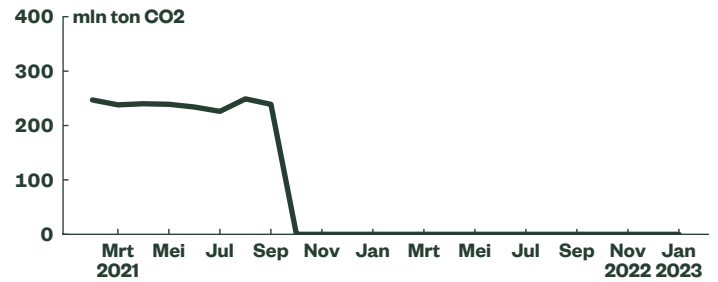
Fonds

Broeikasgasemissies scope 1+2



Fonds

Totale reserves broeikasgasemissies



Fonds

Bron: SSGA Holdings per 28 Feb 2023, data per 31 Jan 2023.

Stewardship-profiel 4e kwartaal 2022

Aantal vergaderingen waarin is gestemd	12
Aantal landen	6
Voorstellen van de directie	118
Stemmen "Voor"	96,61%
Stemmen "Tegen"	3,39%
Voorstellen van aandeelhouders	0
In lijn met de directie	0,00%
Niet in lijn met de directie	0,00%

De cijfers zijn gebaseerd op het algemene stemgedrag van State Street Global Advisors voor de ondernemingen waarin het fonds aan het einde van het kwartaal een belang heeft. Deze informatie is geen vervanging voor een rapport inzake stemming bij volmacht, dat via uw relatiebeheerder kan worden opgevraagd.

Het stewardshipprogramma van State Street Global Advisors (SSGA) is gericht op het aangaan van de dialoog met de bedrijven in ons fonds over kwesties die invloed hebben op de waardecreatie op de lange termijn op het gebied van milieu, maatschappij en governance (ESG). Kort geleden heeft SSGA uitgebreid advies verstrekt over belangrijke zaken op het gebied van ondernemingsbestuur, zoals effectief, onafhankelijk voorzitterschap. De huidige focus van SSGA ligt op het ondersteunen van ondernemingsbesturen bij het nadenken over de mogelijke gevolgen van kwesties op het gebied van milieu en maatschappij en het opnemen van een duurzaamheidsperspectief in het bestuurtoezicht op de langetermijnstrategie als onderdeel van goed ondernemerschap.

Genderdiversiteit

Vrouwen in directie	Aantal effecten
0	0
1	3
2	17
3	40
4	45
5	45
6	27
7	11
8	8
9	3
10	1
10+	0
Niet beschikbaar	0
Totaal	200

Bron: Factset/SSGA per 31 Jan 2023.

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 beoordelingschaal 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-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/1107414/000119312519192334/d774617d497.htm>

CO2-intensiteit- gemeten als tonnen CO2-equivalent gedeeld door de omzet in USD miljoen. De gecombineerde CO2-voetafdruk van de bedrijfsactiviteiten en de directe toeleveringsketens van in de index opgenomen bedrijven per USD (gelijke weging).

Gewogen gemiddelde CO2-intensiteit- gemeten als tonnen CO2-equivalent gedeeld door de omzet in USD miljoen. Het gewogen gemiddelde van de individuele bedrijfsintensiteiten (emissies van de bedrijfsactiviteiten en directe toeleveringsketen / omzet), gewogen naar het relatieve aandeel van elk in de index opgenomen bedrijf.

Scope 1+2 CO2-emissies- gemeten in tonnen CO2-equivalent. De broeikasgasemissies van activiteiten die in eigendom of onder controle zijn van het bedrijf en de broeikasgasemissies door het verbruik van de door het bedrijf aangekochte elektriciteit,

warmte of stoom.

Totale reserves CO2-emissies- Gemeten in tonnen CO2-equivalent. De CO2-voetafdruk die gegenereerd zou kunnen worden als de bewezen en waarschijnlijke reserves aan fossiele brandstoffen in handen van in de index opgenomen bedrijven per belegd miljoen USD zou worden verbrand. In tegenstelling tot CO2-intensiteit en CO2-emissies is de S&P Trucost Total Reserves Emissions-meeteenheid een zeer specifieke indicator die alleen van toepassing is op een streng geselecteerd aantal bedrijven in de winningsindustrie en bedrijven die veel CO2 uitstoten. Deze bedrijven krijgen van Trucost numerieke resultaten van de Totale reserves emissies, terwijl de overige holdings in andere industriebranches geen numerieke scores hebben maar een 'nul'-score, een blanco-waarde tonen. Om een ruimer overzicht te tonen van de totale gewogen gemiddelde reserves aan fossiele brandstoffen vervangt State Street Global Advisors de blancoresultaten door "nullen". Hoewel het uiteindelijke gewogen gemiddelde volume hiermee mogelijk licht wordt onderschat, wordt er toch een meer realistisch resultaat verkregen, aangezien de meeste bedrijven in wereldwijde indices geen eigenaar zijn van fossiele-brandstofreserves.

Genderdiversiteit Wij gebruiken momenteel de 'People'-dataset van FactSet om inzicht te verkrijgen in het aantal vrouwen in de directie van elk bedrijf in de portefeuille van het fonds. De gegevens en cijfers zijn als volgt verkregen bij de onderstaande bronnen op de datum van dit rapport, en zijn onderworpen aan onderstaande toelichtingen. Alle overige gegevens zijn afkomstig van SSGA.

Informatie van Trucost CO2-intensiteit, Gewogen gemiddelde CO2-intensiteit, Scope 1 + 2 CO2-emissies, Totale reserves CO2-emissies Trucost™ is een gedeponerd handelsmerk van S&P Trucost Limited ("Trucost") en wordt in licentie gebruikt. Het ESG Report wordt op geen enkele wijze gesponsord, aanbevolen, verkocht of gepromoot door Trucost of gelieerde entiteiten (gezamenlijk de 'Licentiegevers') en geen van de Licentiegevers doet of geeft enige bewering, voorspelling, garantie of verklaring, uitdrukkelijk noch geïmpliceerd, met betrekking

tot (i) de resultaten die verkregen kunnen worden door het gebruik van Trucost-gegevens samen met het rapport, of (ii) de geschiktheid van de Trucost-gegevens voor het doel waarvoor de data samen met het rapport wordt gebruikt. Geen van de Licentiegevers doet enig financieel of beleggingsadvies of -aanbeveling in verband met het rapport. De Licentiegevers wijzen elke aansprakelijkheid (door nalatigheid of door iets anders) jegens derden voor eventuele fouten in de Trucost-gegevens af. Geen van de Licentiegevers is verplicht om derden over eventuele fouten in de Trucost-gegevens in te lichten.

Informatie van FactSet Genderdiversiteit Deze publicatie kan bedrijfseigen informatie van FactSet bevatten ('FactSet-Informatie') die op geen enkele wijze gereproduceerd, gebruikt, gedistribueerd, gewijzigd of gepubliceerd mag worden zonder de uitdrukkelijke, voorafgaande, schriftelijke toestemming van FactSet. De informatie wordt 'as is' geleverd. Alle verklaringen en garanties, zowel mondeling als schriftelijk, uitdrukkelijk als geïmpliceerd (door de wet, statuten of op andere wijze) worden hierbij uitgesloten en van de hand gewezen, voor zover dat door de wet is toegestaan. Inzake de FactSet-Informatie wijst FactSet in het bijzonder alle geïmpliceerde garanties van verkoopbaarheid en geschiktheid voor een bepaald doel van de hand en geeft geen garanties inzake de nauwkeurigheid, volledigheid, tijdigheid, functionaliteit en/of betrouwbaarheid daarvan. De FactSet-Informatie mag niet worden gezien als beleggingsadvies en alle meningen of verklaringen in de publicaties die FactSet-Informatie bevatten (en/of de FactSet-Informatie zelf) zijn niet de meningen of overtuigingen van FactSet, de aangesloten en/of verbonden entiteiten, en/of hun medewerkers. FactSet is niet aansprakelijk voor enige schade die voortvloeit uit het gebruik, op enigerlei wijze, van deze publicatie of FactSet-Informatie die daarin is opgenomen.

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