

Aktien

31 Oktober 2023

**Anteilsklasse**

[P] Alle Anleger

**Anlageziel des Fonds**

Das Ziel des Fonds besteht darin, die Performance der Aktienmärkte der Eurozone nachzubilden.

**Anlagestrategie**

Die Anlagepolitik des Fonds sieht vor, die Performance des MSCI EMU ex UNGC and CW Index (oder eines anderen Index, der vom Verwaltungsrat jeweils festgelegt wird und im Wesentlichen denselben Markt wie der Index abbildet) so genau wie möglich nachzubilden und dabei den Nachbildungsunterschied zwischen der Performance des Fonds und jener des Index so gering wie möglich zu halten.

Der Index misst die Performance von Aktien der Eurozone. Wertpapiere werden nach der um den Streubesitz bereinigten Marktkapitalisierung gewichtet, nachdem Wertpapiere auf der Grundlage einer Beurteilung ihrer Einhaltung von ESG-Kriterien, d. h. der Nichteinhaltung von UNGC-Prinzipien (internationale Normen in Bereichen wie Umwelt, Menschenrechte und Gemeinschaften, Arbeitsrechte und Lieferketten, Kunden und Unternehmensführung) und kontroversen Waffen, herausgefiltert wurden.

**Benchmark**

MSCI EMU EX UNGC AND CW INDEX

**Struktur**

Investment Company

**UCITS-konform****Domizil**

Luxemburg

**Nur für französische Investoren**

PEA berechtigt

**Fondsdaten**

<b>ISIN</b>	LU1159238036	
<b>NAV</b>	15,25 EUR per 31 Oktober 2023	
<b>Währung</b>	EUR	
<b>Fondsvolumen (NAV) (Mio.)</b>	273,57 EUR per 31 Oktober 2023	
<b>Auflagedatum</b>	28 September 2015	
<b>SFDR-Fondsklassifizierung</b>	SFDR – Artikel 8	
<b>Anlagestil</b>	Index	
<b>Land/Region</b>	Economic Monetary Union/ Eurozone	
<b>Abrechnung</b>	Zyklus für die Abrechnung von Rücknahmen, DD+2; Zyklus für die Abrechnung von Zeichnungen, DD+2	
<b>Mitteilungsfrist</b>	DD 11:00 Uhr MEZ	
<b>Bewertung</b>	Täglich, Börsenschluss	
<b>Swingfaktor<sup>1</sup></b>	<b>Kauf</b>	<b>Verkauf</b>
	0,16%	0,02%
<b>Einmalanlage</b>	EUR 50,00	
<b>Folgeinvestments</b>	EUR 50,00	
<b>Managementgebühren</b>	0,6%	
<b>Tatsächliche TER</b>	0,70%	
<b>Kosten</b>	<b>Kauf</b>	<b>Verkauf</b>
<b>Zahlbar an den Fonds</b>	k.A	Bis zu 2%

<sup>1</sup> Anhaltspunkt zum Datum dieses Factsheets, Änderungen vorbehalten

**Wertentwicklung**

Annualisiert	Benchmark	Fonds vor Kosten (brutto)	Differenz	Fonds nach Kosten (netto)	Differenz
1 Jahr (%)	11,61	12,18	0,58	11,40	-0,20
3 Jahre (%)	10,84	11,48	0,64	10,70	-0,13
5 Jahre (%)	5,73	6,31	0,58	5,57	-0,16
Seit Auflage (%)	3,81	4,47	0,65	3,79	-0,03
<b>Kumuliert</b>					
1 Monat (%)	-3,22	-3,21	0,01	-3,27	-0,05
3 Monate (%)	-9,17	-9,13	0,04	-9,29	-0,12
1 Jahr (%)	11,61	12,18	0,58	11,40	-0,20
3 Jahre (%)	36,13	38,50	2,36	35,65	-0,49
5 Jahre (%)	32,10	35,75	3,65	31,13	-0,97
Seit Auflage (%)	154,08	197,03	42,94	152,37	-1,71
<b>Kalenderjahr</b>					
2023 (seit Jahresbeginn)	6,79	7,31	0,52	6,69	-0,10
2022	-12,74	-12,23	0,50	-12,84	-0,10
2021	22,34	23,20	0,86	22,36	0,01
2020	-1,02	-0,66	0,35	-1,36	-0,34
2019	25,47	26,18	0,71	25,32	-0,15

**Die Wertentwicklung der Vergangenheit ist keine Garantie für zukünftige Ergebnisse.****Eine Anlage ist mit Risiken verbunden, einschließlich des Risikos eines Kapitalverlusts.**

Die hierin enthaltenen Zahlen zur Wertentwicklung werden vor und nach Abzug von Gebühren angegeben. Der Abzug von Gebühren berücksichtigt nicht den Abzug von Beratungs- oder sonstigen Gebühren, welche die Rendite schmälern könnten. Die Indexrenditen reflektieren Kapitalgewinne und -verluste, Erträge und die Wiederanlage von Dividenden. Die Wertentwicklung berücksichtigt die Wiederanlage von Dividenden und sonstigen Unternehmensgewinnen und wird in der Währung berechnet, die in den Fondsdaten angegeben ist. Für das Kalenderjahr, in das das Auflegungsdatum entweder des betreffenden Fonds oder des an die vergangene Wertentwicklung gebundenen Fonds fällt (je nachdem welches das frühere Datum ist), ist die Angabe der Wertentwicklung im Kalenderjahr unvollständig.

Dieser Fonds hat aufgrund der Zusammenlegung mit dem SSGA EMU Index Equity Fund mit Sitz in Frankreich ein neues Auflegungsdatum zum 28. September 2015. Die Tabelle und die Grafik zur Wertentwicklung bilden historische Daten ab dem 30. November 1998 ab.

Die Berechnungsmethode für Value-Added-Renditen kann Rundungsdifferenzen aufweisen.

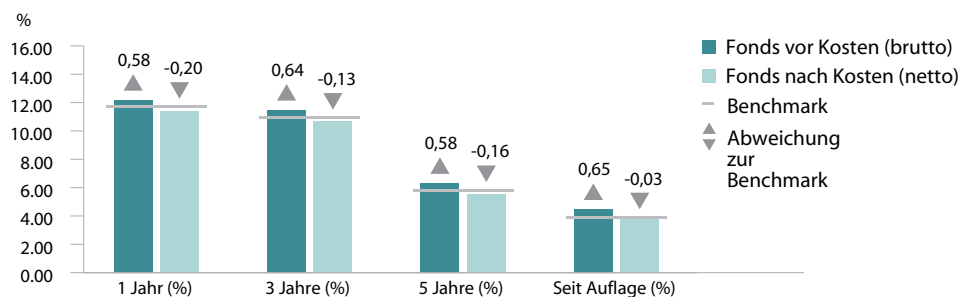
Sind bei einer Schließung des Fonds gemäß seinem offiziellen Nettoinventarwert (NAV)-Kalender Preise für einen maßgeblichen Teil der zugrunde liegenden Wertpapiere ermittelbar, so wird ein technischer NAV berechnet. Die angegebene frühere Wertentwicklung wurde daher erforderlichenfalls auf Grundlage eines technischen NAV und des offiziellen NAV des Fonds zu jedem anderen Geschäftstag des betreffenden Zeitraums berechnet.

Vor dem 28. Mai 2021 war der Fonds unter der Bezeichnung State Street EMU Index Equity Fund bekannt und bildete den MSCI EMU Index nach.

Vor dem 1. Januar 2023 war der Fonds unter der Bezeichnung State Street EMU ESG Screened Index Equity Fund.

Quelle: SSGA.

Alle Daten entsprechen dem Stand vom 31/10/2023

**Annualisierte Wertentwicklung****Fondsmerkmale**

	Fonds	Benchmark
Durchschnittlich gewichtete Marktkapitalisierung (in Mio.)	€60 876	€60 700
Durchschnittliches Preis/Buch-Verhältnis	1,61	1,61
Erwartetes KGV (nächste 12 Monate)	11,41	11,38
Gewichtetes Preis/Cash Flow Verhältnis	6,42	6,39
Dividendenrendite (%)	3,32	3,33
Anzahl der Vermögenswerte*	226	226

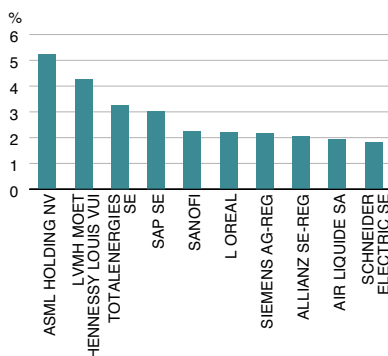
**Kennzahlen**

	3 Jahre
Standardabweichung (%)	17,72
Tracking Error (%)	0,22
Beta	1,00

\* Die Anzahl von dem Fond notierten Stammaktien kann cash Positionen enthalten.

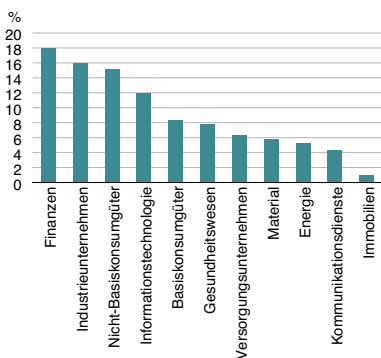
**Top-10-Positionen**

	<b>Gewichtung (%)</b>
ASML HOLDING NV	5,22
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	4,27
TOTALENERGIES SE	3,26
SAP SE	3,03
SANOFI	2,23
L OREAL	2,19
SIEMENS AG-REG	2,18
ALLIANZ SE-REG	2,04
AIR LIQUIDE SA	1,92
SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,82



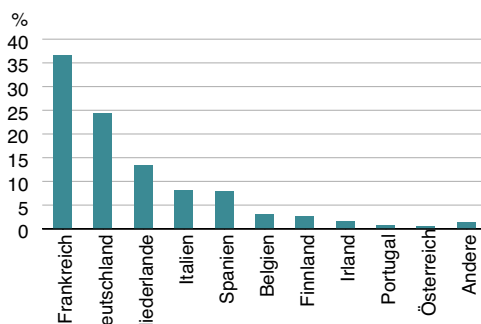
**Branchen**

	<b>Fonds (%)</b>
Finanzen	17,95
Industrieunternehmen	15,95
Nicht-Basiskonsumgüter	15,23
Informationstechnologie	12,01
Basiskonsumgüter	8,34
Gesundheitswesen	7,78
Versorgungsunternehmen	6,36
Material	5,76
Energie	5,26
Kommunikationsdienste	4,41
Immobilien	0,94
<b>Gesamt</b>	<b>100,00</b>



**Länder**

	<b>Fonds (%)</b>
Frankreich	36,50
Deutschland	24,35
Niederlande	13,29
Italien	8,10
Spanien	7,90
Belgien	3,00
Finnland	2,58
Irland	1,56
Portugal	0,66
Österreich	0,59
Andere	1,46
<b>Gesamt</b>	<b>100,00</b>



**Für weitere Informationen**

Besuchen Sie unsere Website [www.ssga.com](http://www.ssga.com) oder wenden Sie sich an Ihre SSGA-Niederlassung vor Ort.

**SSGA Belgien**

+32 (0) 2 663 2016

**SSGA Frankreich**

+33 (0) 1 44 45 40 48

**SSGA Deutschland**

+49 (0) 89 55878 999

**SSGA Irland**

+353 (1) 776 3188 / +353 (1) 776 3029

**SSGA Italien**

+39 02 3206 6121

**SSGA Middle East & Africa**

+971 2 245 9000

**SSGA Niederlande**

+31 (0) 20 718 1701

**SSGA Schweiz**

+41 (0) 44 245 7099

**SSGA Vereinigtes Königreich**

+44 (0) 20 3395 2333

Quelle: SSGA.

Die angegebenen Merkmale, Bestände, Länderallokationen und Sektoren beziehen sich auf das ganz oben auf diesem Factsheet angegebene Datum und können sich ändern. „Sonstige“ bezeichnet bei Ländern den Zusammenschluss von Ländern, die nicht bereits in den Top-10 des Fonds enthalten sind.

**BITTE BEACHTEN SIE, DASS VOLLSTÄNDIGE EINZELHEITEN ZU DEN DEM FONDS ZUGRUNDE LIEGENDEN BESTÄNDEN AUF [WWW.SSGA.COM](http://WWW.SSGA.COM) ENTHALTEN SIND**

**Marketingmitteilung – Allgemeiner Zugang. Nur für professionelle Kunden.**

Dieses Material dient Ihrer persönlichen Information. Die hier erteilten Informationen stellen keine Anlageberatung gemäß Definition nach der Richtlinie über Märkte für Finanzinstrumente (2014/65/EU) oder geltenden Schweizer Vorschriften dar und sollten nicht als Grundlage für eine Anlageentscheidung herangezogen werden. Es werden keine Erklärungen oder Zusicherungen bezüglich der Richtigkeit der Informationen abgegeben, und State Street haftet nicht für Entscheidungen, die auf Basis dieser Informationen getroffen werden.

Bitte lesen Sie die aktuellen wesentlichen Anlegerinformationen (WAI) und den Prospekt des Fonds, bevor Sie eine endgültige Anlageentscheidung treffen. Die aktuelle englische Fassung des Prospekts und der WAI finden Sie unter [www.ssga.com](http://www.ssga.com). Eine Zusammenfassung der Anlegerrechte finden Sie hier: <https://www.ssga.com/library-content/products/fund-docs/summary-of-investor-rights/ssga-investors-rights-summary-template-non-etf-Lux.pdf> Beachten Sie, dass die Verwaltungsgesellschaft beschließen kann, die für die Vermarktung getroffenen Vereinbarungen zu beenden und die Notifizierung gemäß Artikel 93a der Richtlinie 2009/65/EG zu löschen.

Diese Informationen sind für professionelle Kunden bestimmt (wozu auch geeignete Gegenparteien gehören), die sowohl als sachkundig sowie als erfahren in Angelegenheiten im Zusammenhang mit Anlagen gelten.

Bei den in dieser Kommunikation enthaltenen Informationen handelt es sich nicht um eine Analystenempfehlung oder „Anlageresearch“, sie sind vielmehr gemäß der Richtlinie über Märkte für Finanzinstrumente (2014/65/EU) oder geltenden Schweizer Vorschriften als „Marketingmitteilung“ klassifiziert. Dies bedeutet, dass diese Marketingmitteilung (a) nicht gemäß Rechtsvorschriften erstellt wurde, die die Unabhängigkeit von Anlageresearch fördern sollen, (b) keinem Verbot in Bezug auf den Handel vor der Verbreitung von Anlageresearch unterliegt.

Diese kollektive Kapitalanlage und ihre Vertriebsstelle sind von der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht (FINMA) nach dem Kollektivanlagengesetz (KAG) und der Schweizer Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (Kollektivanlagenverordnung, KKV) zugelassen. Die kollektive Kapitalanlage wurde nach dem Recht Luxemburgs als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) strukturiert und ist als OGAW von der Commission de Surveillance de Secteur Financier (CSSF) zugelassen. Potenzielle Anleger können den aktuellen Prospekt, die Satzung, die wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) sowie den letzten Jahres- und Halbjahresbericht kostenlos von der Vertretung und Zahlstelle in der Schweiz, State Street Bank International GmbH, München, Niederlassung Zürich, Beethovenstrasse 19, CH-8027 Zürich, beziehen.

© 2020 Morningstar, Inc. Alle Rechte vorbehalten. Die hierin enthaltenen Informationen: (1) sind geschützte Informationen von Morningstar und/oder ihren Content-Anbietern; (2) dürfen nicht vervielfältigt oder weitergegeben werden; und (3) ihre Richtigkeit, Vollständigkeit oder Aktualität kann nicht zugesichert werden. Weder Morningstar noch seine Content-Anbieter haften für Schäden oder Verluste, die aus der Verwendung dieser Informationen resultieren.

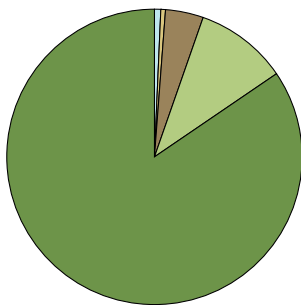
Dieses Werk darf ohne ausdrückliche schriftliche Einwilligung von SSGA weder ganz noch teilweise vervielfältigt, kopiert oder übertragen und sein Inhalt gegenüber Dritten nicht offen gelegt werden.

## R-Factor™ Zusammenfassung

R-Factor™ wird aufgebaut anhand einer transparenten Bewertungsmethode, die die Materiality Map des Sustainability Accounting Standards Board (SASB), Corporate-Governance-Kodizes und Informationen von vier Best-in-Class-ESG-Datenanbietern nutzt. R-Factor unterstützt die Entwicklung nachhaltiger Kapitalmärkte, indem es Anlegern die Möglichkeit bietet, in Lösungen zu investieren, die finanziell wesentliche ESG-Daten integrieren, und Unternehmen gleichzeitig Anreize gibt, ihre ESG-Praktiken und die Veröffentlichungs- und Informationspolitik in maßgeblichen Bereichen zu optimieren.

### R-Factor-Profil des Fonds

<span style="color: lightblue;">■</span> Nicht verfügbar	0,69%
<span style="color: blue;">■</span> Nachzügler	0,00%
<span style="color: orange;">■</span> Underperformer	0,51%
<span style="color: brown;">■</span> Durchschnitt	4,15%
<span style="color: lightgreen;">■</span> Outperformer	10,13%
<span style="color: green;">■</span> Spitzenreiter	84,51%



Quelle: Factset/SSGA zum Stand vom 30 Sep 2023

## R-Factor

R-Factor-Zusammenfassung	Fonds
R-Factor	78

Quelle: Factset/SSGA zum Stand vom 30 Sep 2023

Fondsberichterstattung	Anzahl	Prozentualer Anteil an den gesamten Wertpapieren	Prozentualer Anteil am gesamten Marktwert
R-Factor-Wertpapierberichterstattung	224	99,12%	99,31%
Gesamtanzahl der Wertpapiere im Fonds	226		

Quelle: Factset/SSGA zum Stand vom 30 Sep 2023

Top-10-Positionen	Fondsgewichtung	R-Factor-Rating
ASML Holding NV	5,22%	83
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	4,27%	73
TotalEnergies SE	3,26%	83
SAP SE	3,03%	88
Sanofi	2,23%	93
L'Oreal S.A.	2,19%	95
Siemens Aktiengesellschaft	2,18%	82
Allianz SE	2,04%	87
L'Air Liquide S.A.	1,92%	78
Schneider Electric SE	1,82%	99

Quelle: Factset/SSGA zum Stand vom 30 Sep 2023

### Höchste 5 R-Factor-Ratings

Danone SA	0,82%	100
Schneider Electric SE	1,82%	99
Aena SME SA	0,24%	97
Intesa Sanpaolo S.p.A.	0,88%	96
Capgemini SE	0,62%	96

Quelle: Factset/SSGA zum Stand vom 30 Sep 2023

### Niedrigste 5 R-Factor-Ratings

Sofina SA	0,06%	38
RATIONAL AG	0,06%	38
Delivery Hero SE	0,11%	39
EXOR N.V.	0,20%	41
Nemetschek SE	0,09%	41

Quelle: Factset/SSGA zum Stand vom 30 Sep 2023

Aus der R-Factor-Zusammenfassung gehen lediglich bestimmte ESG-Merkmale hervor, nicht die Wertentwicklung des Fonds. Weitere Informationen und Definitionen der angegebenen ESG-Kennzahlen entnehmen Sie bitte dem Abschnitt Wichtige Informationen.

### Klima-Kennzahlen

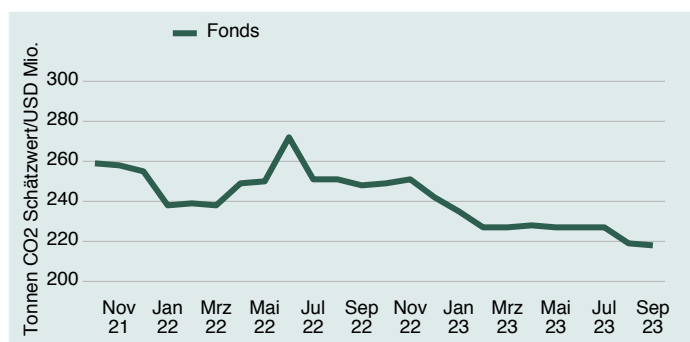
#### TCFD – Kohlenstoff-Kennzahlen

	Fonds
TCFD – Gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität (WACI)	115,14
TCFD – Gesamte Kohlenstoffemissionen**	23 062,40*
TCFD – CO2-Bilanz	81,24
TCFD – Kohlenstoffintensität	166,75

Quelle: State Street Global Advisors, S&P Trucost, FactSet, Task Force on Climate-related Financial Disclosures (TCFD). Die Ergebnisse sind Schätzungen, die auf Annahmen und Analysen von State Street Global Advisors basieren. Sie sind nicht dazu gedacht, die tatsächlichen Ergebnisse eines Angebots darzustellen. Tatsächliche Ergebnisse können abweichen. \* Die TCFD-Kennzahl „Gesamte Kohlenstoffemission“ ordnet die Emissionen den Anlegern auf der Grundlage eines Eigenkapitalansatzes zu. Bei gemischten Fonds stellen die Ergebnisse die Umweltverantwortung des gesamten verwalteten Fondsvermögens dar. Für die Verantwortung des einzelnen Anteilinhabers kann eine anteilige Verantwortung auf der Grundlage des prozentualen Anteils der einzelnen Anlage berechnet werden. \*\* Die Kennzahl wird nicht zum Vergleich von Portfolios und Benchmarks verwendet, da die Daten nicht normalisiert sind.

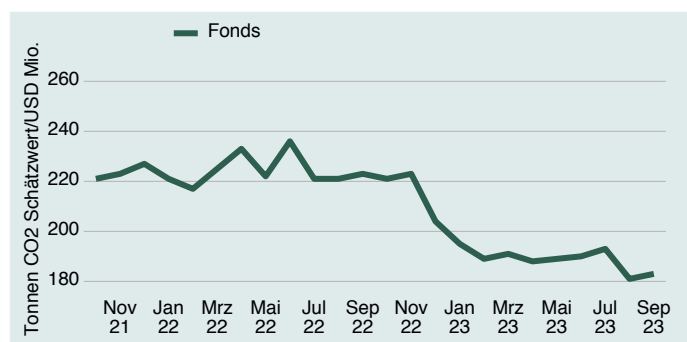
### Klimaprofil

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



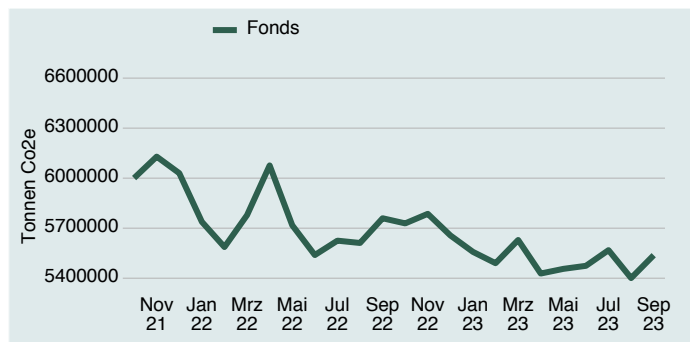
Quelle: SSGA Holdings per Stand 31 Okt 2023. Trucost Daten per Stand 30 Sep 2023.

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



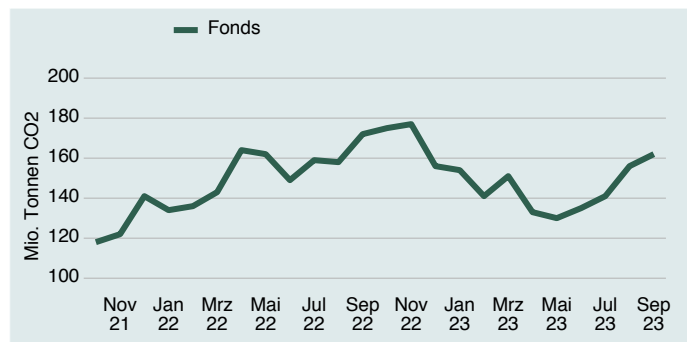
Quelle: SSGA Holdings per Stand 31 Okt 2023. Trucost Daten per Stand 30 Sep 2023.

#### Kategorien 1 + 2 Kohlenstoffemissionen



Quelle: SSGA Holdings per Stand 31 Okt 2023. Trucost Daten per Stand 30 Sep 2023.

#### Gesamtreserven Kohlenstoffemissionen



Quelle: SSGA Holdings per Stand 31 Okt 2023. Trucost Daten per Stand 30 Sep 2023.

## Stewardship-Profil

Per 31 Okt 2023

## Stewardship-Profil

Q3 2023

<b>Anzahl der Versammlungen mit Stimmabgabe</b>	13
<b>Anzahl der Länder</b>	6
<b>Vorschläge des Managements</b>	138
Stimmen „Dafür“	92,03%
Stimmen „Dagegen“	7,97%
<b>Vorschläge der Aktionäre</b>	0
Für das Management	0,00%
Gegen das Management	0,00%

Die Zahlen beruhen auf dem allgemein von State Street Global Advisors verfolgten Ansatz zur Stimmabgabe bei den vom Fonds zu Quartalsende gehaltenen Unternehmen. Diese Angaben ersetzen nicht den Bericht über die Stimmabgabe, der über Ihren Kundenbetreuer angefordert werden kann.

Das Asset-Stewardship-Programm von State Street Global Advisors (SSGA) soll mit unseren Fondsunternehmen in Dialog treten zu Fragen, die sich bei allen Aspekten im Zusammenhang mit Umwelt, Sozialem und Governance (ESG) auf die langfristige Wertschöpfung auswirken. In der jüngeren Vergangenheit hat SSGA ausführliche Vorgaben zu maßgeblichen Governance-Sachverhalten herausgegeben wie effektive unabhängige Führung durch den Verwaltungsrat. Derzeit liegt der Fokus von SSGA darauf, Verwaltungsratsgremien dabei zu unterstützen, über potenzielle Auswirkungen ökologischer und sozialer Fragen nachzudenken und bei ihrer Aufsicht über die langfristige Strategie als solides Geschäftsgebahren eine Nachhaltigkeitsperspektive einzubeziehen.

## Geschlechterdiversität

Frauen im Verwaltungsrat	Anzahl der Wertpapiere
0	1
1	2
2	16
3	26
4	44
5	47
6	50
7	21
8	11
9	4
10	3
10+	1
Nicht verfügbar	0
<b>Gesamt</b>	<b>226</b>

Quelle: Factset/SSGA zum Stand vom 30 Sep 2023

**R-Factor™**

R-Factor™ ist ein ESG-Scoring-System, das allgemein anerkannte wesentlickeitsbezogene Rahmenwerke nutzt, um einen einzigartigen ESG-Score für börsennotierte Unternehmen zu ermitteln. Der Score basiert auf ESG-Daten von vier verschiedenen Anbietern, um die Gesamtabdeckung zu verbessern und Verzerrungen existierender Bewertungsmethoden zu beseitigen. R-Factor™ soll Unternehmen in die Lage versetzen, bei der Schaffung nachhaltiger Märkte zu helfen.

**R-Factor™ Scores** sind branchenübergreifend vergleichbar. Die ESG- und Corporate-Governance (CorpGov)-Scores basieren ihrer Konzeption nach auf Themen, die für die Branche und die regulatorische Region eines Unternehmens wesentlich sind. Eine einheitliche Bewertungsskala ermöglicht die Interpretation des endgültigen Score eines Unternehmens, da somit unternehmensübergreifende Vergleiche angestellt werden können.

**Der R-Factor™** Scoring-Prozess setzt sich aus zwei zugrundeliegenden Komponenten zusammen. Die erste Komponente basiert auf dem vom Sustainability Accounting Standards Board („SASB“) veröffentlichten Rahmenwerk. Dieses wird mit Ausnahme von Corporate-Governance-Belangen für alle ESG-Aspekte des Scores verwendet. Das SASB-Rahmenwerk strebt danach, diejenigen ESG-Risiken zu identifizieren, die basierend auf seiner Branchenzugehörigkeit für einen Emittenten von finanzieller Wichtigkeit sind. Diese Komponente des R-Factor™ Scores wird nur anhand der Kennzahlen der ESG-Datenanbieter bestimmt, die sich speziell mit den ESG-Risiken befassen, die vom SASB-Rahmenwerk für den Emittenten, basierend auf seiner Branchenzugehörigkeit, als finanziell wesentlich identifiziert wurden. Die zweite Komponente des Scores ist der CorpGov-Score. Dieser wird anhand von regionenspezifischen Corporate-Governance-Kodizes generiert, die von Anlegern oder Aufsichtsbehörden entwickelt wurden. Governance-Kodizes beschreiben die Mindestanforderungen an die Corporate Governance in einer bestimmten Region und beziehen sich für gewöhnlich auf Themen wie Aktionärsrechte, die Unabhängigkeit des Verwaltungsrats und die Vergütung von Führungskräften. Diese Komponente des R-Factor™ verwendet die von ISS Governance bereitgestellten Daten, um den Emittenten gemäß diesen Governance-Kodizes einen Governance-Score zuzuordnen. Das Responsible-Factor-Scoring (R-Factor) wurde von State Street entwickelt, um bestimmte ESG-Merkmale widerzuspiegeln. Es steht nicht für eine Anlageperformance. Ergebnisse, die aus dem Scoring-Modell erzielt werden, basieren auf den Dimensionen Nachhaltigkeit (Sustainability) und Unternehmensführung (Corporate Governance) eines beurteilten Unternehmens.

Die Rendite eines Wertpapierportfolios, das Unternehmen ausschließt, welche die spezifizierten ESG-Kriterien des Portfolios nicht erfüllen, kann hinter der Rendite eines Wertpapierportfolios, das solche Unternehmen einschließt, zurückbleiben. Die ESG-Kriterien eines Portfolios können dazu führen, dass das Portfolio in Branchen oder Wertpapiere investiert, die schwächer abschneiden als der Gesamtmarkt.

**R-Factor™ Profil**

Innerhalb jeder Branchengruppe werden die Emittenten, basierend auf dem Perzentil ihrer R-Factor™ Scores, in fünf verschiedene ESG-Performance-Gruppen eingestuft. Ein Unternehmen wird in eine der fünf ESG-Performance-Gruppen (Nachzügler - 10 % des Universums, Underperformer - 20 % des Universums, durchschnittlicher Performer - 40 % des Universums, Outperformer - 20 % des Universums oder Spitzenreiter - 10 % des Universums) eingeordnet, indem der R-Factor™ Score eines Unternehmens auf einer Skala verglichen wird. R-Factor™ Scores werden gewöhnlich mit normierten Ratings auf einer Bewertungsskala von 0-100 verteilt.

Beispiele für die öffentliche Sprache in Bezug auf den R-Factor finden Sie in der ELR-Registrierungserklärung hier: <https://www.sec.gov/Archives/edgar/data/1107414/00011931251912334/d774617d497.htm>

**Kohlenstoffintensität (Direkt+Indirekt)** Gemessen in Tonnen CO2e/USD Millionen Umsatz. Die Aggregation der CO2-Bilanzen von Indexkomponenten pro USD (gleichgewichtet) in der operativen und First-Tier-Lieferkette.

**Gewichteter Durchschnitt Kohlenstoffintensität (Direkt+Indirekt)** Gemessen in Tonnen CO2e/USD Millionen Umsatz. Der gewichtete Durchschnitt der Intensitäten der einzelnen Unternehmen (Emissionen aus der operativen und First-Tier-Lieferkette gegenüber den Umsatz), gewichtet nach dem Anteil der einzelnen Komponenten des Index.

**Kategorien 1 + 2 Kohlenstoffemissionen** Gemessen in Tonnen CO2e. Die Treibhausgasemissionen aus Betriebsabläufen, die sich im Besitz oder unter der Kontrolle des Unternehmens befinden, sowie die Treibhausgasemissionen aus dem Verbrauch von durch das Unternehmen bezogener Elektrizität, Wärme oder Dampf.

**Total Reserves CO2 Emissions** Gemessen in Tonnen CO2e. Die CO2-Bilanz, die entstehen könnte, wenn die nachgewiesenen und wahrscheinlichen fossilen Brennstoff-Reserven der Indexwerte verbrannt würden, pro investierter Million USD. Im Gegensatz zur Kohlenstoffintensität und den CO2-Emissionen ist die Kennzahl der S&P Trucost Total Reserves Emissions ein sehr spezifischer Indikator, der nur für eine sehr begrenzte Zahl von Unternehmen in mineralgewinnenden und kohlenstoffintensiven Branchen Anwendung findet. Diesen Unternehmen werden von Trucost numerische Ergebnisse bezogen auf ihre Emissionen gegenüber bestehenden Gesamtreserven (Total Reserves Emissions) zugewiesen, während der Rest der Portfoliobestände aus anderen Branchen keine numerischen Werte aufweist und stattdessen „null“, also leere Werte anzeigt. Um einen umfassenderen Überblick über die gewichteten durchschnittlichen fossilen Brennstoff-Reserven eines Portfolios in ihrer Gesamtheit zu erhalten, ersetzt State Street Global Advisors leere Ergebnisse durch „Nullen“. Obschon dadurch das endgültige gewichtete Durchschnittsvolumen leicht unterschätzt werden könnte, liefert diese Methode ein realistischeres Ergebnis, da die meisten Unternehmen in den globalen Indizes selbst keine fossilen Brennstoff-Reserven ihr Eigen nennen.

**TCFD – Gewichtete durchschnittliche Kohlendioxid-Emissionsintensität** – Das Engagement des Portfolios in kohlenstoffintensiven Unternehmen, ausgedrückt in Tonnen CO2e/Mio. USD Umsatz. Scope-1- und Scope-2-THG-Emissionen werden den Portfoliogewichtungen (der aktuelle Wert der Anlage im Verhältnis zum aktuellen Portfoliowert) entsprechend umgelegt.

**TCFD – Gesamte Kohlendioxidemissionen** – Die absoluten Treibhausgasemissionen, die mit einem Portfolio verbunden sind, ausgedrückt in Tonnen CO2e. Scope-1- und Scope-2-THG-Emissionen werden auf der Grundlage eines Eigenkapitalansatzes auf Anleger umgelegt.

**TCFD – CO2-Bilanz** – Gesamte Kohlendioxidemissionen eines Portfolios, die nach dem Marktwert des Portfolios normalisiert und in Tonnen CO2e/investierte Mio. USD ausgedrückt werden. Scope-1- und Scope-2-THG-Emissionen werden auf der Grundlage eines Eigenkapitalansatzes auf Anleger umgelegt.

**TCFD – Kohlendioxid-Emissionsintensität** – Volumen der Kohlendioxidemissionen pro Mio. USD Umsatz (Kohlendioxidintensität eines Portfolios), ausgedrückt in Tonnen CO2e/Mio. USD Umsatz. Scope-1- und Scope-2-THG-Emissionen werden auf der Grundlage eines Eigenkapitalansatzes auf Anleger umgelegt.

**Geschlechterdiversität**

Wir verwenden derzeit den FactSet-eigenen Datensatz „People“, um die Anzahl der Frauen im Verwaltungsrat für jedes Portfoliounternehmen des Fonds zu ermitteln.

Die Daten und Kennzahlen wurden zum Zeitpunkt dieses Berichts von den folgenden Stellen wie nachstehend erläutert erhoben und unterliegen den unten aufgeführten Hinweisen. Alle anderen Daten stammen von SSGA.

**Trucost-Abschnitte:** Kohlenstoffintensität, Gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität, Scope 1 + 2 Kohlenstoffemissionen, Total Reserves CO2 Emissions  
Trucost® ist eine eingetragene Marke von S&P Trucost Limited („Trucost“) und wird unter Lizenz verwendet. Der ESG-Bericht wird in keiner Weise von Trucost oder seinen Konzerngesellschaften (zusammen die „lizenzgebenden Parteien“) gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben, und keine der lizenzgebenden Parteien gibt irgendwelche Behauptungen oder Prognosen bzw. Erklärungen oder Zusicherungen, ob ausdrücklich oder stillschweigend, hinsichtlich (i) der Ergebnisse, die durch die Verwendung der Trucost-Daten in dem Bericht erzielt werden können, oder hinsichtlich (ii) der Eignung der Trucost-Daten für den Zweck, zu dem sie im Zusammenhang mit dem Bericht verwendet werden, ab. Keine der lizenzgebenden Parteien erteilt eine Finanz- oder Anlageberatung oder Empfehlung in Bezug auf den Bericht. Keine der lizenzgebenden Parteien haftet (ob aus Fahrlässigkeit oder anderweitig) anderen Personen gegenüber für Fehler in den Trucost-Daten oder ist verpflichtet, andere Personen über Fehler darin zu informieren.

**FactSet-Abschnitte; Geschlechtervielfalt**

Diese Publikation kann urheberrechtlich geschützte Informationen von FactSet enthalten („FactSet-Informationen“), die ohne die ausdrückliche, vorherige schriftliche Zustimmung von FactSet nicht vervielfältigt, verbreitet, verändert oder in irgendeiner Weise veröffentlicht werden dürfen. Die FactSet-Informationen werden „wie besehen“ bereitgestellt, und alle Zusicherungen und Gewährleistungen, ob mündlich oder schriftlich, ausdrücklich oder stillschweigend (nach allgemeinem Recht oder gesetzlich oder anderweitig), werden hiermit ausgeschlossen und abgelehnt, soweit dies gesetzlich zulässig ist. Insbesondere in Bezug auf die FactSet-Informationen lehnt FactSet jegliche stillschweigende Gewährleistung der Marktgängigkeit und Eignung für einen bestimmten Zweck ab und übernimmt keine Garantie im Hinblick auf Richtigkeit, Vollständigkeit, Aktualität, Funktionalität und/oder Zuverlässigkeit. Die FactSet-Informationen sind nicht als Anlageberatung zu verstehen. Sämtliche Meinungen oder Behauptungen in einer Veröffentlichung mit FactSet-Informationen (und/oder die FactSet-Informationen selbst) stellen nicht die Meinungen oder Überzeugungen von FactSet, seinen Konzerngesellschaften und/oder verbundenen Unternehmen und/oder einem ihrer jeweiligen Mitarbeiter dar. FactSet haftet nicht für Schäden, die sich aus der Verwendung dieser Publikation oder der herein enthalten FactSet-Informationen ergeben.