

Fest verzinsliche

30 April 2024

Anteilsklasse

[B GBP Portfolio Hedged Distributing] Institutionelle Investoren

Anlageziel des Fonds

Das Ziel des Fonds besteht darin, die Performance des globalen Anleihenmarkts nachzubilden.

Anlagestrategie

Die Anlagepolitik des Fonds sieht vor, die Performance des Bloomberg Global Aggregate Bond 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 des weltweiten Rentenmarkts. Der Index umfasst Staats-, regierungsnahe und Unternehmensanleihen sowie Asset-Backed-, Mortgage-Backed- und Commercial Mortgage-Backed Securities von Emittenten aus entwickelten und Schwellenmärkten. Wertpapiere müssen festverzinslich und mit „Investment Grade“ bewertet sein, wie durch die Indexmethodik definiert.

In Bezug auf Unternehmensanleihen bedient sich der Anlageverwalter vor dem Aufbau des Portfolios des Fonds und fortlaufend eines negativen und normenbasierten ESG-Screenings.

Benchmark

Bloomberg Global Aggregate Bond Index (GBP hedged)

Struktur

Investment Company

UCITS-konform**Domizil**

Luxemburg

Fondsdaten

ISIN	LU2545195880	
NAV	10,13 GBP per 30 April 2024	
Währung	GBP	
Fondsvolumen (NAV) (Mio.)	3 859,69 USD per 30 April 2024	
Auflagedatum	29 Dezember 2022	
Anlagestil	Index	
Land/Region	Global	
Abrechnung	Zyklus für die Abrechnung von Rücknahmen, DD+2; Zyklus für die Abrechnung von Zeichnungen, DD+2	
Mitteilungsfrist	DD-1 14:00 Uhr MEZ	
Bewertung	Täglich, Börsenschluss	
Swingfaktor ¹		
Kauf	0.10%	
Verkauf	0.01%	
Einmalanlage	GBP 10 000 000,00	
Folgeinvestments	GBP 5 000,00	
Managementgebühren	0%	
Tatsächliche TER	k.A	
Kosten	Kauf	Verkauf
Zahlbar an den Fonds	k.A	Bis zu 2%

¹ Anhaltspunkt zum Datum dieses Factsheets, Änderungen vorbehalten

Wertentwicklung

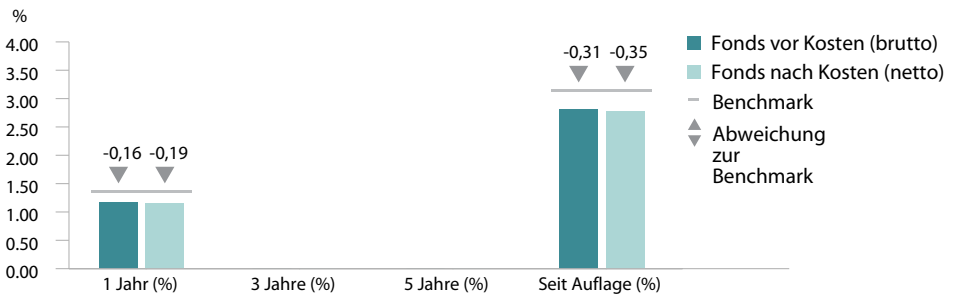
Annualisiert	Benchmark	Fonds vor Kosten (brutto)	Differenz	Fonds nach Kosten (netto)	Differenz
1 Jahr (%)	1,34	1,17	-0,16	1,15	-0,19
3 Jahre (%)	-	-	-	-	-
5 Jahre (%)	-	-	-	-	-
Seit Auflage (%)	3,12	2,82	-0,31	2,78	-0,35
Kumuliert					
1 Monat (%)	-1,64	-1,69	-0,05	-1,69	-0,05
3 Monate (%)	-1,49	-1,53	-0,05	-1,54	-0,05
1 Jahr (%)	1,34	1,17	-0,16	1,15	-0,19
3 Jahre (%)	-	-	-	-	-
5 Jahre (%)	-	-	-	-	-
Seit Auflage (%)	4,20	3,78	-0,41	3,73	-0,47
Kalenderjahr					
2024 (seit Jahresbeginn)	-1,70	-1,80	-0,11	-1,91	-0,22
2023	6,22	6,07	-0,14	6,14	-0,08
2022	-0,21	-0,36	-0,15	-0,36	-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. 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 1. Dezember 2021 war die Benchmark des Fonds der Bloomberg Barclays Global Aggregate Bond Index.

Quelle: SSGA.

Alle Daten entsprechen dem Stand vom 30/04/2024

Annualisierte Wertentwicklung**Fondsmerkmale**

	Fonds	Benchmark
Anzahl der Vermögenswerte*	7 765	30 121
Durchschnittliche (optionsbereinigte) Endfälligkeitsrendite (%)	4,05	4,06
Rückzahlungsrendite (%)	4,05	4,06
Laufende Rendite (%)	2,89	2,98
Durchschnittlicher Kupon (%)	2,72	2,81
Optionsbereinigter Spread (in Basispunkten)	37,62	38,34
Effektive Duration (Jahre)	6,57	6,56
Durchschnittliche Restlaufzeit (Jahre)	8,52	8,48
Effektive Konvexität	0,81	0,81
Durchschnittliches Rating	A1	A1

Kennzahlen

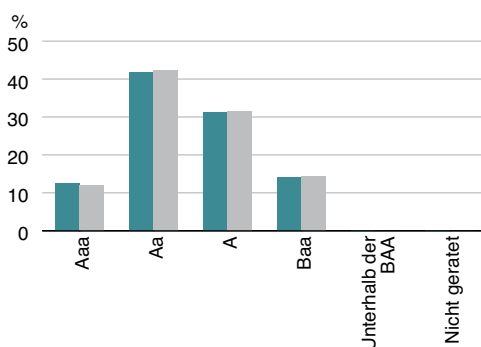
	3 Jahre
Standardabweichung (%)	-
Tracking Error (%)	-
Beta	-

* Die Anzahl von dem Fond notierten Emissionen kann cash positionen enthalten.

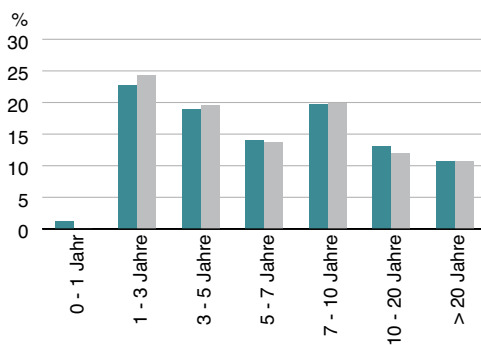
Länder	Fonds (%)	Benchmark (%)
USA	40,44	40,21
Japan	10,44	10,30
China	9,81	9,91
Frankreich	5,21	5,22
Deutschland	4,79	4,76
Großbritannien	4,22	4,25
Kanada	3,60	3,50
Italien	3,12	3,14
Supranational	2,39	2,47
Spanien	2,29	2,30
Andere	13,69	13,93
Gesamt	100,00	100,00

Branchen	Fonds (%)	Benchmark (%)
Staatsanleihen	52,25	52,80
Mortgage Backed Securities	12,43	12,18
Industrien	9,59	9,60
Finanzsektor	7,48	7,24
Agent	6,40	6,78
Non Corporates	5,60	5,85
Andere	2,84	3,00
Versorger	1,60	1,64
Cash	1,13	-
CMBS	0,66	0,66
Asset Backed Securities	0,03	0,25
Gesamt	100,00	100,00

Kreditrating-Positionen	Fonds (%)	Benchmark (%)
Aaa	12,64	11,89
Aa	41,86	42,33
A	31,30	31,45
Baa	14,14	14,33
Unterhalb der BAA	0,01	-
Nicht geratet	0,05	-
Gesamt	100,00	100,00



Fälligkeiten	Fonds (%)	Benchmark (%)
0 - 1 Jahr	1,14	-
1 - 3 Jahre	22,68	24,28
3 - 5 Jahre	18,87	19,47
5 - 7 Jahre	13,96	13,75
7 - 10 Jahre	19,65	19,88
10 - 20 Jahre	13,06	11,97
> 20 Jahre	10,64	10,65



Quelle: SSGA.

Die angegebenen Merkmale, Kreditrating-Positionen, 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.

Die Bonitätsbewertung basiert auf einem Durchschnitt von Moody's, S & P und Fitch.

BITTE BEACHTEN SIE, DASS VOLLSTÄNDIGE EINZELHEITEN ZU DEN DEM FONDS ZUGRUNDE LIEGENDEN BESTÄNDEN AUF WWW.SSGA.COM ENHALTEN 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. 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.

„Bloomberg®“ und alle Bloomberg-Indizes sind Dienstleistungsmarken von Bloomberg Finance L.P. und seinen verbundenen Unternehmen, einschließlich Bloomberg Index Services Limited („BISL“), dem Verwalter des Index (zusammen „Bloomberg“), und wurden für bestimmte Zwecke von State Street Bank and Trust Company, durch seine Abteilung State Street Global Advisors („SSGA“), lizenziert. Bloomberg ist nicht mit SSGA verbunden. Bloomberg genehmigt, befürwortet, prüft oder empfiehlt kein Produkt von SSGA. Bloomberg gibt keinerlei Garantien für die Aktualität, Genauigkeit oder Vollständigkeit von Daten oder Informationen in Bezug ein SSGA-Produkt ab.

Die hierin erwähnten Marken und Dienstleistungsmarken sind Eigentum ihrer jeweiligen Inhaber. Unabhängige Datendienste machen keinerlei Zusicherungen oder Garantien bezüglich der Richtigkeit, Vollständigkeit oder Aktualität der Daten und haften nicht für Schäden jeglicher Art im Zusammenhang mit der Nutzung dieser Daten.

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.

Für weitere Informationen

Besuchen Sie unsere Website 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 (87) 469 8361

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

Klima-Kennzahlen

Klima-Kennzahlen		Fonds
Gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität (WACI)	Gewichtete durchschnittliche CO ₂ -Emissionen pro 1 Mio. USD Umsatz	29,93
WACI-Deckung	Gewichteter Marktwert (%)	18,58%
	Anzahl der Wertpapiere (%)	48,34%
Reserven fossiler Brennstoffe	Gewichteter Durchschnitt des eingebetteten CO ₂ (in Millionen Tonnen)	13,26
Braune Einnahmen	% vom Umsatz	0,39%
Anpassungs-Score (0–1)	Gewichtete durchschnittliche Punktzahl von 0 (niedrig) bis 1 (hoch)	0,56
Green Bonds und klimagerechte Anleihen	Gewichteter Marktwert (%)	3,14%
Green Bonds	Gewichteter Marktwert (%)	2,59%
Klimagerechte Anleihen	Gewichteter Marktwert (%)	0,63%

TCFD – Kohlenstoff-Kennzahlen

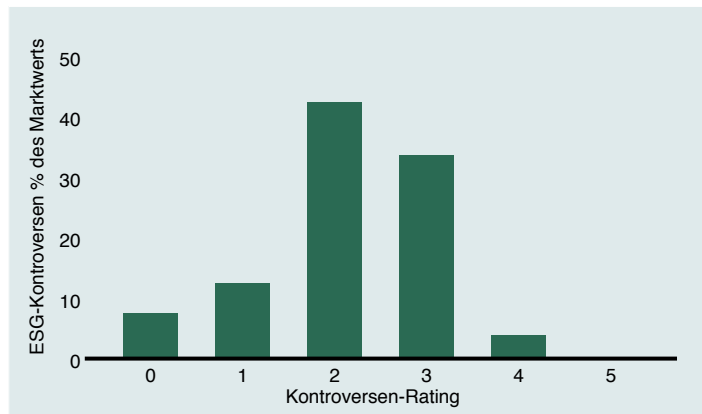
TCFD – Kohlenstoff-Kennzahlen		Fonds
TCFD – Gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität (WACI)		26,76
TCFD – Gesamte Kohlenstoffemissionen**		38 044,17*
TCFD – CO ₂ -Bilanz		9,81
TCFD – Kohlenstoffintensität		134,23

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 Anteilnehmers 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.

Kontroversenprofil

Per 30 Apr 2024

Kontroversenprofil des Fonds



Quelle: Sustainalytics/SSGA zum Stand vom 31 Mrz 2024
 Das Controversies Research von Sustainalytics ist zur Ermittlung von Unternehmen konzipiert, die an Vorfällen und Ereignissen beteiligt sind, welche aufgrund der potenziellen Auswirkungen auf die Beteiligten, die Umwelt oder den Betrieb des Unternehmens ein Geschäfts- oder Reputationsrisiko darstellen können. Sustainalytics bewertet die Beteiligung von Unternehmen an Vorfällen mit negativen Auswirkungen auf Umwelt, Soziales und Governance (ESG). Das Research basiert auf Informationen aus einem breiten Spektrum internationaler und lokaler Nachrichten- und NRO-Quellen. Die Skala reicht von Kategorie 0 (kein Indiz) bis Kategorie 5 (besonders schwerwiegend). Wertpapiere, für die kein Kontroversenwert verfügbar war, wurden aus vorstehenden Berechnungen ausgeschlossen und der Fonds wurde neu gewichtet. Die Tabelle entspricht nicht unbedingt 100 % des Fonds.

Kontroversen und Beteiligung von Unternehmen

	Fonds
ESG-Kontroversen	0,00%
Kontroverse Waffen	0,00%
Verstöße gegen den UNGC	0,00%
Zivile Waffen	0,00%
Tabak	0,00%
Kraftwerkskohle	0,00%
Verstöße gegen den Swedish Ethical Council	0,00%
Ölsandabbau	0,00%
Öl- und Gasförderung in der Arktis	0,00%

Quelle: State Street Global Advisors ESG-Screeningmethode mit Stand vom 31 Mrz 2024.

ESG Risk Rating Score

	Fonds
ESG Risk Rating Score	20,95
Deckung (Marktwert in Prozent)	20,54
Deckung (Anzahl der Wertpapiere in Prozent)	51,77

Quelle: Sustainalytics/SSGA zum Stand vom 31 Mrz 2024

Die oben angegebenen ESG-/Nachhaltigkeitsinformationen dienen nur zu Informationszwecken. Diese Informationen sollen den Anlegern Transparenz im Hinblick auf Umwelt-, Sozial- oder Governance-Merkmale des Fonds bieten. Die Bereitstellung dieser Informationen sollte nicht als Darstellung des aktuellen oder zukünftigen Anlageziels des Fonds ausgelegt werden, noch sollte sie als Indikator der aktuellen oder zukünftigen Anlageentscheidungen des Fondsmanagers betrachtet werden. **Dieser Fonds strebt keine nachhaltige, Impact- oder ESG-Strategie an.**

Anleger sollten eine Anlage in den Fonds nicht ausschließlich auf der Grundlage der oben genannten Informationen bewerten, sondern auch andere Faktoren wie das allgemeine Anlageziel und das Risikoprofil des Fonds berücksichtigen. Ausführlichere Informationen über den Fonds sollten Anleger im (<https://www.ssga.com/fund-finder?tab=documents>) des Fonds nachlesen.

Die obigen Drittinformationen wurden aus Quellen bezogen, die zum angegebenen Datum als zuverlässig galten, aber ihre Richtigkeit kann nicht garantiert werden. SSGA haftet nicht für Anlageentscheidungen, die auf diesen Informationen beruhen, und Sie sollten daher diese Informationen nicht als verlässlich betrachten. Es wird keine Gewähr oder Garantie für die aktuelle Richtigkeit, Zuverlässigkeit oder Vollständigkeit dieser Informationen übernommen.

ESG-Kontroversen

Kontroversen-Indikatoren sind ein kritischer Bestandteil des ESG-Ratings für einen Emittenten. Unter einer Kontroverse versteht man eine Reihe von Ereignissen im Rahmen eines ESG-Themas, das gemäß den Auswirkungen auf die Stakeholder strukturiert ist. Auf Ebene der Kontroverse erfolgt keine zusätzliche Bewertung. Das Kontroversen-Rating basiert auf dem strengsten Rating aller Ereignisse gemäß dem Kontroversen-Indikator. Wenn zum Beispiel ein Kontroversen-Indikator drei Ereignis-Ratings enthält, mit zwei Ereignis-Ratings in Kategorie 2 und einem in Kategorie 3, wird das Kontroversen-Rating automatisch zu Kategorie 3. Ein Kontroversen-Indikator wird ferner auf einer Skala von 1 bis 5 bewertet, wobei jedes Rating einem Rohscore mit einer zugeordneten Gewichtung entspricht. Der gewichtete Score des Kontroversen-Indikators fließt direkt in das ESG-Rating ein. Kontroversen-Indikatoren haben verhältnismäßig höhere Gewichtungen.

Gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität - gemessen in Tonnen CO₂e/Mio. USD Umsatz. Der gewichtete Durchschnitt der Intensitäten der einzelnen Unternehmen (Emissionen aus der eigenen Geschäftstätigkeit und von direkten Lieferanten entlang der Lieferkette geteilt durch den Umsatz), dem Anteil jedes Indexunternehmens am Index entsprechend gewichtet.

Reserven fossiler Brennstoffe (auch als CO₂-Budget bezeichnet): gemessen in Tonnen CO₂. Die CO₂-Bilanz, die erzeugt werden könnte, wenn die nachweislichen und die wahrscheinlichsten Reserven fossiler Brennstoffe der Indexunternehmen verbrannt werden, pro investierter Million USD. Im Gegensatz zur Kohlenstoffintensität und den CO₂-Emissionen handelt es sich bei dem von S&P Trucost errechneten CO₂-Budget um einen sehr spezifischen Indikator, der nur auf ganz wenige Unternehmen in mineralgewinnenden und CO₂-intensiven Branchen zutrifft. Diesen Unternehmen werden von Trucost numerische CO₂-Budget-Ergebnisse zugeordnet, während die restlichen Positionen in anderen Branchen keine numerischen Punktzahlen haben, sondern mit „MARKT“ ohne Wertangabe angezeigt werden. Um einen umfassenderen Überblick der gesamten gewichteten durchschnittlichen Reserven fossiler Brennstoffe eines Portfolios zu ermöglichen, ersetzt State Street Global Advisors die ausgelassenen Ergebnisse durch Nullen. Dadurch wird das endgültige gewichtete durchschnittliche Volumen zwar eventuell etwas zu niedrig angegeben, aber man erhält ein realistischeres Ergebnis, denn die meisten Unternehmen in breiten Marktindizes besitzen keine Reserven fossiler Brennstoffe.

Braune Einnahmen in (%): prozentualer Anteil der Einnahmen aus „braunen“ Sektoren - extraktiven Sektoren, wie von S&P Trucost klassifiziert

ISS ESG-Anpassungs-Score: Für diesen Score werden die Kennzahlen „Position on Climate Change“ und „Disclosure of Climate Change Risks and Mitigation Strategy“ herangezogen. Der Indikator „Position on Climate Change“ beurteilt die Positionierung eines Unternehmens in Bezug auf den Klimawandel. Unternehmen müssen klar Stellung nehmen und sich dabei auf die wissenschaftlichen Nachweise des Klimawandels, die Verantwortung des Unternehmens in diesem Zusammenhang und seine Verpflichtung, zur Reduzierung von Treibhausgasemissionen beizutragen, beziehen. Der Indikator „Disclosure of Climate Change Risks and Mitigation Strategy“ beurteilt, ob das Unternehmen die wichtigsten Branchenrisiken in Bezug auf den Klimawandel einschätzt und ob es über entsprechende Anpassungs- und Risikominderungsstrategien verfügt. Das Unternehmen muss alle relevanten branchenspezifischen Risiken (laut Definition des für die Branche zuständigen Analysten) in Bezug auf den Klimawandel (z. B. physische, regulatorische, Markt-, Kosten- und rechtliche Risiken) offenlegen und quantifizieren und umfangreiche Angaben zu den entsprechenden Anpassungs- und Risikominderungsstrategien machen. Jedes Unternehmen erhält ein Rating von (1 bis 4) für jeden Indikator. Wenn weder eine „Position on Climate“-Bewertung noch ein Ziel oder Aktionsplan für die Reduzierung von Treibhausgasemissionen vorhanden ist, erhält das Unternehmen keinen Anpassungs-Score.

Emittenten von Green Bonds und klimagerechten Anleihen: State Street Global Advisors (SSGA) identifiziert Wertpapiere, die gemäß der Taxonomie der Climate Bonds Initiative (CBI) infrage kommen. Für Rückvergleiche werden Green Bonds anhand von Daten von Thomson Reuters identifiziert und dann auf CBI-Daten umgeändert, sofern diese verfügbar sind. Der Green-Bond-Markt möchte sich so weiterentwickeln, dass er die wichtige Rolle des Anleihemarkts bei der Finanzierung von Projekten, die zu ökologischer Nachhaltigkeit beitragen, übernehmen kann. Einige Datenanbieter haben zwar Vorschläge für ein Green-Bond-Label, aber am Markt gibt es keine einheitliche Definition für Green Bond. Die International Capital Market Association schlug Richtlinien zu vier Elementen vor: 1. Verwendung des Erlöses, 2. Verfahren für die Bewertung und Auswahl von Projekten, 3. Verwaltung des Erlöses und 4. Reporting. Am 17. Juni 2020 begann State Street Global Advisors die Zusammenarbeit mit CBI und trat dem Partnernetz von CBI bei. Wenn die Nachhaltigkeit einer Anleihe mit Green-Bond-Label unabhängig überprüft wird, haben wir mehr Vertrauen in die Verwendung des Erlöses. Da der Green-Bond-Markt ziemlich konzentriert ist, umfasst die Klimastrategie auch Anleihen mit dem Label „klimagerecht“. Klimagerechte Anleihen sind solche, die nach Einschätzung von CBI Vermögensgegenstände und Aktivitäten finanzieren, die Lösungen für den Klimawandel unterstützen. Das Universum der klimagerechten Anleihen setzt sich zusammen aus: a) Anleihen ohne Label von Emittenten, die mehr als 95 % ihres Umsatzes in „grünen“ Geschäftsfeldern erzielen. Diese Emittenten sind als „vollkommen ausgerichtet“ definiert. b) Anleihen von Emittenten ohne Label, die 75 bis 95 % ihres Umsatzes in „grünen“ Geschäftsfeldern erzielen. Diese Emittenten sind als „stark ausgerichtet“ definiert. c) Anleihen mit dem Label „Green Bond“, die von „grünen“ Anleiheemittenten begeben wurden. Ausführlichere Informationen über die CBI-Taxonomie finden Sie auf: <https://www.climatebonds.net/standard/taxonomy>.

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

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.

Sustainalytics-Abschnitte: Kontroversen-Profil und ESG-Risikobewertungsscore von Portfolios - Teile dieser Publikation können urheberrechtlich geschützte Informationen von Sustainalytics enthalten, die ohne die ausdrückliche schriftliche Zustimmung von Sustainalytics weder vervielfältigt, verwendet, verbreitet oder geändert noch anderweitig veröffentlicht werden dürfen. Diese Publikation enthält nichts, was als ausdrückliche oder stillschweigende Zusicherung oder Gewähr hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Unternehmen oder Einbeziehung von Unternehmen in ein investierbares Universum und/oder Portfolio ausgelegt werden darf. Die Informationen werden ohne Mängelgewähr bereitgestellt und Sustainalytics übernimmt daher keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen. Sustainalytics haftet nicht für Schäden, die bei jedweder Nutzung dieser Publikation oder der darin enthaltenen Informationen entstehen.

Trucost-Abschnitte CO₂-Intensität (Direkt+Indirekt), gewichtete durchschnittliche CO₂-Intensität (Direkt+Indirekt), Gesamtemissionen CO₂, CO₂-Fußabdruck. Trucost® ist eine eingetragene Marke von S&P Trucost Limited („Trucost“). Die Nutzung wurde im Rahmen einer Lizenz gestattet. Der ESG-Bericht wird weder von Trucost noch von mit Trucost verbundenen Unternehmen (zusammen die „Lizenzgeber“) gesponsert, verkauft, beworben oder anderweitig unterstützt. Kein Lizenzgeber gibt hinsichtlich der aus der Nutzung von Trucost-Daten mit dem Bericht zu erzielenden Ergebnisse oder hinsichtlich der Eignung von Trucost-Daten für die Zwecke, zu denen diese Daten im Zusammenhang mit dem Bericht genutzt werden, direkt oder indirekt Erklärungen, Prognosen, Zusicherungen oder Garantien ab. Im Zusammenhang mit dem Bericht ist keiner der Lizenzgeber beratend (Finanzberatung, Investmentberatung) tätig oder gibt Empfehlungen ab. Die Lizenzgeber haften gegenüber Dritten nicht für etwaige aus Fahrlässigkeit oder anderweitig entstandene Fehler in den Trucost-Daten und sind nicht verpflichtet, auf Fehler aufmerksam zu machen.