

SPDR MSCI ACWI Climate Paris Aligned UCITS ETF

Nachtrag Nr. 56

(Ein Teilfonds der SSGA SPDR ETFs Europe II plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft, die als Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teifonds errichtet und von der irischen Zentralbank gemäß den OGAW-Vorschriften zugelassen wurde).

Dieser Nachtrag (der „Nachtrag“) ist Bestandteil des Prospekts vom 28. Oktober 2022 in der jeweils gültigen Fassung (der „Prospekt“) für die Gesellschaft. Dieser Nachtrag ist zusammen mit dem Prospekt und den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) zu lesen. Er enthält Informationen über den SPDR MSCI ACWI Climate Paris Aligned UCITS ETF (der „Fonds“), repräsentiert durch die Anteilsserie SPDR MSCI ACWI Climate Paris Aligned UCITS ETF der Gesellschaft (die „Anteile“).

Alle Anteile in diesem Fonds sind als ETF-Anteile ausgewiesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder aufgrund des Kontextes nicht anders erforderlich, haben alle in diesem Nachtrag verwendeten definierten Begriffe dieselbe Bedeutung wie im Prospekt.

Potenzielle Anleger sollten den gesamten Nachtrag, den Prospekt und die wesentlichen Anlegerinformationen aufmerksam lesen. Falls Sie bezüglich des Inhalts dieses Nachtrags Fragen haben, wenden Sie sich bitte an Ihren Wertpapiermakler oder Finanzberater. Potenzielle Anleger sollten vor einer Anlage in dem Fonds die im Prospekt und in diesem Nachtrag beschriebenen Risikofaktoren berücksichtigen. Die Gesellschaft und die Verwaltungsratsmitglieder, deren Namen im Abschnitt „Management“ des Prospekts aufgeführt sind, übernehmen die Verantwortung für die in diesem Nachtrag enthaltenen Informationen.

SPDR MSCI ACWI Climate Paris Aligned UCITS ETF

Fondsmerkmale

Basiswährung	USD.
Anlageverwalter	State Street Global Advisors Europe Limited.
Der/die Unteranlageverwalter	State Street Global Advisors Limited.
Ausschüttungspolitik	<p>Bei ausschüttenden Anteilklassen, halbjährliche Ausschüttung des Ertrags (in oder um die Monate Juni und Dezember), außer wenn die Verwaltungsgesellschaft nach alleinigem Ermessen beschließt, zu einem bestimmten Ausschüttungstermin keine Dividende auszuschütten.</p> <p>Bei thesaurierenden Anteilklassen werden alle Erträge und Gewinne im Nettoinventarwert je Anteil thesauriert. Ausschüttender/thesaurierender Status gemäß Angabe in den umseitigen Informationen zu den Anteilklassen.</p>
SFDR-Fondsklassifizierung	Artikel 8-Fonds, vom Index einbezogenes Nachhaltigkeitsrisiko.

Handelsinformationen

Orderannahmeschluss	<p>Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung: 16:00 Uhr (irischer Zeit) an jedem Handelstag.</p> <p>Für alle Zeichnungen und Rücknahmen gegen Barzahlung am letzten Handelstag vor dem 25. Dezember und 1. Januar jeden Jahres: 11:00 Uhr (irischer Zeit).</p> <p>Die Verwaltungsgesellschaft kann nach vorheriger Benachrichtigung der autorisierten Teilnehmer frühere oder spätere Zeitpunkte festlegen.</p> <p>Der Handel gegen Sachwerten durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.</p>
Abrechnungszeitpunkt	15:00 Uhr (irischer Zeit) am dritten Geschäftstag nach dem Handelstag oder zu einem späteren Zeitpunkt, der vom Anlageverwalter bestimmt oder mit der Verwaltungsgesellschaft vereinbart werden kann. Die Verwaltungsgesellschaft/die Gesellschaft benachrichtigt die Anteilinhaber, wenn (i) für Zeichnungen ein früherer Abrechnungszeitpunkt gilt oder (ii) für Rücknahmen ein späterer Abrechnungszeitpunkt gilt. Die Abrechnung kann durch die Abrechnungsfristen der zugrunde liegenden Märkte beeinträchtigt werden.
Handelbarer Nettoinventarwert	Der Nettoinventarwert je Anteil, der zum Bewertungszeitpunkt an dem auf den maßgeblichen Handelstag folgenden Geschäftstag berechnet wird.
Mindestzeichnungs- und -rücknahmebetrag	Genauere Informationen zu den aktuellen Mindestzeichnungs- und -rücknahmebeträgen für den Fonds können autorisierte Teilnehmer den Betriebsrichtlinien für autorisierte Teilnehmer entnehmen.

Angaben zum Index

Index (Ticker)	MSCI ACWI Climate Paris Aligned Index (MXACCLPA).
Häufigkeit des Index-Rebalancing	Halbjährlich.
Zusätzliche Angaben zum Index	<p>Weitere Einzelheiten zum Index und seine Wertentwicklung finden Sie unter:</p> <p>https://www.msci.com/constituents</p> <p>https://www.msci.com/documents/10199/a543310d-d383-f688-0769-17d309fb79db</p> <p>https://www.msci.com/eqb/methodology/meth_docs/MSCI_Climate_Paris_Aligned_Indexes.pdf</p>

Bewertungsangaben

Bewertung	Der Nettoinventarwert je Anteil wird gemäß dem Abschnitt „ Ermittlung des Nettoinventarwerts “ im Prospekt berechnet.
Zur Bewertung herangezogene Kurse	Zuletzt gehandelt.
Bewertungszeitpunkt	22:15 Uhr (irischer Zeit) an jedem Geschäftstag.

Informationsklassifizierung: Allgemeines

SPDR MSCI ACWI Climate Paris Aligned UCITS ETF

Anteilklassen

Art der Anteilkasse	USD nicht abgesichert		USD abgesichert		EUR abgesichert		GBP abgesichert		CHF abgesichert		
Name	SPDR MSCI ACWI Climate Paris Aligned UCITS ETF		SPDR MSCI ACWI Climate Paris Aligned USD Hdg UCITS ETF		SPDR MSCI ACWI Climate Paris Aligned EUR Hdg UCITS ETF		SPDR MSCI ACWI Climate Paris Aligned GBP Hdg UCITS ETF		SPDR MSCI ACWI Climate Paris Aligned CHF Hdg UCITS ETF		
Ausschüttungspolitik*	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	Acc	Dist	
Währung der Anteilkasse	USD		USD		EUR		GBP		CHF		
TER (weitere Informationen dazu sind dem Abschnitt „Gebühren und Kosten“ im Prospekt zu entnehmen.)	Bis zu 0,20 %		Bis zu 0,25 %								

*Ausschüttungspolitik: „Acc“ = Thesaurierende Anteile; „Dist“ = Ausschüttende Anteile

Anlageziel und -politik

Anlageziel: Das Anlageziel des Teilfonds ist die Nachbildung der Aktienmarkt-Wertentwicklung von Industrie- und Schwellenländern.

Anlagepolitik: Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der Index-Wertentwicklung zu minimieren.

Der Index soll die Wertentwicklung einer Untergruppe von Aktienwerten von Unternehmen im MSCI ACWI Index (der „übergeordnete Index“) widerspiegeln, die gemäß der Indexmethode ausgewählt und gewichtet werden. Ziel der Indexmethode ist die Reduzierung von Übergangs- und physischen Klimarisiken, wobei gleichzeitig Gelegenheiten verfolgt werden, die sich aus dem Übergang zu einer CO₂-ärmeren Wirtschaft ergeben, und ein auf die Anforderungen des auf der Grundlage des Rahmenübereinkommens der Vereinten Nationen über Klimaänderungen geschlossenen Übereinkommens von Paris (das „Übereinkommen von Paris“) abgestimmtes Portfolio angestrebt wird. Der übergeordnete Index misst die Wertentwicklung von Aktien mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung in Industrie- und Schwellenländern. Der Index soll die in der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1818 der Kommission für die Methodik von Referenzwertindizes, die auf die Ziele des Übereinkommens von Paris abgestimmt sind, festgelegten Mindeststandards für die auf das Übereinkommen von Paris abgestimmten EU-Referenzwerte übertreffen. Der Index schließt bestimmte Unternehmen aufgrund ihrer Beteiligung an den folgenden Kontroversen Geschäftsaktivitäten aus: Kontroverse Waffen, Tabak, Öl und Gas sowie Abbau und Verstromung von Kraftwerkskohle, wobei in der Indexmethodik näher erläutert wird, wie der Indexanbieter eine „Beteiligung“ definiert. Der Index schließt zudem Unternehmen aus, die vom Indexanbieter als in Kontroversen verwickelt identifiziert werden, die negative ESG-Auswirkungen auf ihre Geschäftstätigkeit und/oder Produkte und Dienstleistungen haben. Die Ausschlüsse basieren auf einem MSCI ESG Controversy Score („**MSCI ESG Controversy Score**“). Aus dem MSCI-ESG-Kontroversen-Score geht eine Einschätzung des Indexanbieters zu Kontroversen in Bezug auf negative Folgen des Betriebs, der Produkte und Dienstleistungen des Unternehmens auf Umwelt, Soziales und/oder Unternehmensführung hervor. Der von MSCI-ESG-Kontroversen herangezogene Bewertungsrahmen ist so konzipiert, dass er mit internationalen Normen in Einklang steht, die von der Menschenrechtserklärung der Vereinten Nationen, der Erklärung der ILO über grundlegende Prinzipien und Rechte bei der Arbeit und dem UN Global Compact repräsentiert werden. Der MSCI-ESG-Kontroversen-Score liegt auf einer Skala von 0 bis 10, wobei „0“ für die schwerwiegendsten Kontroversen steht. Unternehmen, die vom Indexanbieter als mit Kontroversen im Zusammenhang mit Umweltthemen konfrontiert ermittelt werden, sind auf der Grundlage eines MSCI Environmental Controversy Score („**MSCI-Umwelt-Kontroversen-Score**“)

vom Index ausgeschlossen. Die vom Indexanbieter zur Ermittlung der Eignung für die Aufnahme in den Index festgelegten MSCI-ESG-Kontroversen-Mindest-Scores und MSCI-Umwelt-Kontroversen-Mindest-Scores sind auf der Webseite des Indexanbieters zu finden: <https://www.msci.com/index-methodology>.

Die übrigen Komponenten werden dann zur Aufnahme im Index ausgewählt und gewichtet, um Übergangs- und physische Klimarisiken zu reduzieren, sich aus dem Übergang zu einer CO₂-ärmeren Wirtschaft ergebende Gelegenheiten zu verfolgen sowie eine Abstimmung mit den Zielen des Übereinkommens von Paris und eine Minimierung des Ex-ante-Tracking-Errors gegenüber dem übergeordneten Index anzustreben. In dieser Phase wird die Indexmethode:

(i) bestimmte Beschränkungen auf Indexebene anwenden, indem:

- eine Reduzierung der Treibhausgas-(THG-)Emissionsintensität im Vergleich zum übergeordneten Index angestrebt wird;
- eine Mindest-Dekarbonisierungsrate für die Reduzierung der THG-Emissionsintensität pro Jahr angestrebt wird;
- ein Engagement in Sektoren mit einer hohen Auswirkung auf den Klimawandel mindestens dem übergeordneten Index entsprechend zur Abstimmung mit den Zielen des Übereinkommens von Paris angestrebt wird, einschließlich Engagements in Sektoren, die THG-Emissionen aktiv reduzieren sollten; und

(ii) unter Berücksichtigung:

- ein höheres Engagement in Unternehmen, die Ziele zur Emissionsreduzierung veröffentlichen, die ihre jährlichen Emissionen veröffentlichen und ihre THG-Emissionsintensität reduzieren;
- ein Beitrag zur reduzierten, gewichteten, durchschnittlichen potenziellen Emissionsintensität im Vergleich zum übergeordneten Index;
- ein Beitrag zu einem insgesamt höheren sog. Low Carbon Transition (LCT) Score gegenüber dem übergeordneten Index (d. h. ein insgesamt niedrigeres Engagement in mit Risiken durch LCT konfrontierten Unternehmen und/oder ein insgesamt höheres Engagement in Unternehmen, für die sich Gelegenheiten durch LCT bieten können) gemäß Festlegung durch den Indexanbieter;
- Reduzierung des Engagements in durch extreme Wetterereignisse entstehende physische Risiken im Vergleich zum übergeordneten Index
- Beitrag zu einem insgesamt höheren Engagement in Unternehmen mit einem Mindestverhältnis der „grünen“ zu den „braunen“ Umsatzanteilen im Vergleich zum übergeordneten Index, wobei grüne Umsatzanteile solche sind, auf die Unternehmensumsätze aus Produkten und Dienstleistungen entfallen, die zum Übergang auf eine CO₂-ärmere Wirtschaft beitragen können. Dem stehen braune Umsatzanteile gegenüber, die möglicherweise Umweltschäden verursachen und den Übergang auf eine

CO₂-ärmer Wirtschaft erschweren. (Weitere Informationen über die Bedeutung grüner und brauner Umsatzanteile und deren Berechnung sind der Indexmethode zu entnehmen);

- Beitrag zu insgesamt höheren „grünen“ Umsätzen im Vergleich zum übergeordneten Index; und

- Liquiditäts- und Diversifizierungsobergrenzen auf Komponentenebene,

gemäß den vom Indexanbieter in der Indexmethode festgelegten Grenzwerten für diese Beschränkungen.

Die Übernahme dieser Filter im Index entspricht den vom Fonds geförderten ökologischen und sozialen Faktoren, wie im Unterabschnitt „**ESG-Screening**“ des Abschnitts „**ESG-Anlagen**“ des Prospekts näher beschrieben. Unternehmen, die vom Indexanbieter nicht auf der Grundlage ihres MSCI-ESG-Kontroversen-Scores ausgeschlossen wurden, gelten als eine gute Unternehmensführung aufweisend. Die wichtigsten methodischen Grenzen werden im Unterabschnitt „**Screening-Risiken**“ des Abschnitts „Anlagerisiken“ dieses Nachtrags beschrieben.

Das ESG-Screening gilt für mindestens 90 % des Portfolios.

Das Portfolio des Fonds setzt sich überwiegend aus Wertpapieren zusammen, die den oben und in der Indexmethode beschriebenen ESG-Standards entsprechen (wodurch sichergestellt wird, dass keine Emittenten im Portfolio enthalten sind, deren Aktivitäten dieses Ziel wesentlich beeinträchtigen würden).

Indexkomponenten können von Zeit zu Zeit häufiger neu gewichtet werden als es für die normale Häufigkeit des Index-Rebalancing üblich ist, wenn dies nach der Indexmethodik erforderlich ist, z. B. wenn Kapitalmaßnahmen wie Fusionen oder Übernahmen Komponenten des Index betreffen.

Obwohl der Index im Allgemeinen gut gestreut ist, kann er aufgrund des Marktes, für den er repräsentativ ist, abhängig von Marktbedingungen Komponenten von denselben Emittenten enthalten, die über 10 % des Index ausmachen. Der Fonds bedient sich zwecks genauer Nachbildung des Index der gemäß Regulation 71 der OGAW-Vorschriften verfügbaren höheren Diversifizierungslimits. Diese Grenzen erlauben dem Fonds, Positionen bis maximal 20 % des Nettoinventarwerts des Fonds in vom selben Emittenten ausgegebenen einzelnen Indexkomponenten zu halten.

Es werden abgesicherte Anteilklassen angeboten, um die Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Klassenwährung und der Währung, auf die die zugrunde liegenden Anlagen lauten, zu mindern. Anleger sollten beachten, dass die abgesicherten Anteilklassen (in diesem Nachtrag als solche bezeichnet) in der Währung der betreffenden Klasse abgesichert werden. Dementsprechend dürften die abgesicherten Klassen die entsprechenden währungsgesicherten Versionen des Index genauer nachbilden.

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Strategie stratifizierter Stichproben, wie sie im Abschnitt „**Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds**“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten,

richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann unter außerordentlichen Umständen auch in Wertpapiere investieren, die nicht im Index enthalten sind, die aber seiner Meinung nach den Risiko- und Ausschüttungsmerkmalen der Wertpapiere im Index sehr nahe kommen. Die Aktien, in die der Fonds investiert, werden vorwiegend an anerkannten Märkten entsprechend den in den OGAW-Vorschriften festgelegten Grenzen notiert oder gehandelt Einzelheiten zum Portfolio des Fonds und den indikativen Nettoinventarwert je Anteil des Fonds finden Sie täglich auf der Website.

Ab dem Datum dieses Nachtrags berücksichtigen der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf der Fondsebene, um durch die zugrunde liegenden Anlagen verursachte negative externe Effekte möglichst zu reduzieren.

Dieser Fonds bewirbt ökologische oder soziale Merkmale gemäß Artikel 8 SFDR. Weitere Informationen über die ökologischen und sozialen Merkmale sind dem Anhang dieses Nachtrags zu entnehmen.

Währungsabsicherung: Der Fonds wird derivative Finanzinstrumente („DFI“) einsetzen, u. a. Devisenterminkontrakte, um in den abgesicherten Anteilklassen die Währungsrisiken teilweise oder vollständig abzusichern. Währungsabsicherungsgeschäfte für eine abgesicherte Anteilkasse sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen, und damit verbundene Kosten gehen ausschließlich zu Lasten dieser Klasse. Alle diese Kosten und damit verbundenen Verbindlichkeiten und/oder Erträge spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil der Klasse wider. Aufgrund von Faktoren, die sich dem Einfluss des Anlageverwalters und/oder des Unteranlageverwalters entziehen, können sich zu hoch oder zu niedrig abgesicherte Positionen ergeben, aber diese werden regelmäßig überwacht und angepasst.

Taxonomie-Verordnung: Dieser Fonds bewirbt zwar ökologische Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR, strebt derzeit aber keine „nachhaltige Investition“ im Sinne der Taxonomie-Verordnung an. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ besitzt nur für die dem Fonds zugrunde liegenden Anlagen Gültigkeit, die den EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten Rechnung tragen. Bei den Anlagen, die dem restlichen Teil dieser Fonds zugrunde liegen, werden die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltiges Wirtschaften nicht berücksichtigt. Der Fonds ist nicht verpflichtet, mehr als 0 % seines Nettoinventarwerts in taxonomiekonforme Anlagen zu investieren.

Zugelassene Anlagen

Aktien: Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investiert, können Aktien oder aktienbezogene Wertpapiere wie American Depository Receipts (ADR) oder Global Depository Receipts (GDR) zählen. ADR und GDR werden in der Regel anstelle lokaler Aktien herangezogen, wenn es nicht möglich ist oder zu teuer wäre, die im Index vertretenen lokalen Aktien zu erwerben. Der Fonds kann auch über

Stock Connect oder die RQFII-Quote in chinesische Aktien anlegen.

Sonstige Fonds / liquide Anlagen: Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettovermögens in andere geregelte offene Fonds (einschließlich Geldmarktfonds) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds übereinstimmen und wenn diese Fonds in Mitgliedstaaten des EWR, im Vereinigten Königreich, in den USA, auf Jersey, Guernsey oder der Isle of Man zugelassen sind und in jeder wesentlichen Hinsicht den Bestimmungen der OGAW-Vorschriften entsprechen. Der Fonds kann gemäß den OGAW-Vorschriften zusätzliche liquide Mittel, etwa in Form von Einlagen, halten.

Derivate: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen. Der Einsatz von DFI durch den Fonds beschränkt sich auf Futures und Devisenterminkontrakte (einschließlich Non-Deliverable Forwards) sowie auf Optionsscheine. Effizientes Portfoliomangement bedeutet, dass in Anlageentscheidungen Transaktionen einbezogen werden, die zu einem oder mehreren der folgenden konkreten Zwecke eingegangen werden: Risikominderung, Kostenreduzierung, Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder zusätzlicher Erträge für den Fonds bei einem angemessenen Risikoniveau unter Berücksichtigung des Risikoprofils des Fonds bzw. Minimierung des Tracking Error, also des Risikos, dass der Fondsertrag vom Indexertrag abweicht. DFI werden im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten“ des Prospekts beschrieben.

Wertpapierleih-, Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Derzeit beteiligt sich der Fonds nicht an einem Wertpapierleihprogramm, obwohl er dazu befugt ist. Es ist auch nicht vorgesehen, dass der Fonds Pensions- und umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließt. Sollte der Verwaltungsrat in Zukunft eine Änderung dieser Politik beschließen, werden die Anteilinhaber rechtzeitig informiert und dieser Nachtrag entsprechend aktualisiert.

Anlagerisiken

Eine Anlage in dem Fonds ist mit gewissen Risiken verbunden. Anleger sollten den Abschnitt „Risikoinformationen“ im Prospekt lesen. Darüber hinaus sind die folgenden Risiken für den Fonds besonders relevant.

Indexnachbildungsrisiko: Der Fondsertrag entspricht unter Umständen nicht dem Indexertrag. Derzeit wird davon ausgegangen, dass der Fonds den Index unter normalen Marktbedingungen mit einer potenziellen Abweichung von jährlich bis zu 2 % nachbildet. Die Fähigkeit des Fonds, den Index nachzubilden, wird beeinträchtigt durch Fondsaufwendungen, den Bestand an liquiden Mitteln im Portfolio sowie die Häufigkeit und die zeitliche Gestaltung von Käufen und Verkäufen von Fondsbeleihungen. Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter kann versuchen, den Index nachzubilden, indem er in eine Untergruppe der Indexwertpapiere investiert oder in manche

Wertpapiere, die nicht im Index geführt werden. Dadurch erhöht sich potenziell das Risiko einer Abweichung des Fondsertrags vom Indexertrag.

Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko: Steht nicht jederzeit ein Markt zur Verfügung oder bestehen Einschränkungen für den Wiederverkauf, kann das die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigen, ein Wertpapier zu einem günstigen Zeitpunkt, einem günstigen Kurs oder überhaupt zu veräußern. Illiquide Wertpapiere können gegenüber vergleichbaren liquideren Anlagen zu einem Abschlag gehandelt werden, und ihr Marktwert kann hohen Schwankungen unterliegen. Illiquide Fondspositionen können die Fähigkeit des Fonds einschränken, diese Positionen gegen liquide Mittel zu veräußern, um Rücknahmeanträge zeitnah auszuführen. Investiert der Fonds in illiquide Wertpapiere oder handelt er nicht in großen Stückzahlen, kann sich die Geld-Brief-Spanne des Fonds weiten, der Fonds kann erhöhte Bewertungsrisiken ausgesetzt sein und seine Handelsfähigkeit kann vermindert werden. Fondsanteile können auch zu Kursen gehandelt werden, die sich wesentlich vom zuletzt verfügbaren NIW unterscheiden.

Schwellenländerriesiko: Zu den mit einer Anlage auf Schwellenmärkten verbundenen Risiken zählen unter anderem größere politische und wirtschaftliche Instabilität, mögliche Handelsschranken, geringere staatliche Aufsicht und Regulierung, größere Wechselkursvolatilität, Einschränkungen von Währungstransfers oder Schwierigkeiten beim Engagement in eine Währung, geringer entwickelte Wertpapiermärkte, Rechtssysteme und Finanzdienstleistungsbranchen, Unterschiede bei den Prüfungs- und Finanzberichterstattungsstandards sowie größere Abhängigkeit von Einnahmen aus bestimmten Rohstoffen oder internationaler Hilfe.

Da der Fonds wesentlich in Schwellenmärkten engagiert ist, sollte eine Anlage im Fonds keinen bedeutenden Anteil am Anlageportfolio darstellen und ist unter Umständen nicht für jeden Anleger geeignet.

Risiken im Zusammenhang mit Anlagen in der Volksrepublik China: Neben den Risiken von Anlagen in Schwellenländern zählen zu den Risiken von Anlagen in Märkten der VRC unter anderem Handelsaussetzungen, Beschränkungen von Währungstransfers/-engagements, Grenzen für das Halten von Anlagen in der VRC und die Inanspruchnahme von Maklern, nicht erprobte Konzepte für die neue Handhabung des wirtschaftlichen Eigentums, die Abhängigkeit von Zugangsprogrammen, die eingestellt oder wesentlich verändert werden können, Verwahrstellenrisiken wie beispielsweise eine mangelnde Trennung der Vermögenswerte von denen des RQFII-Lizenziäbers und der Unterdepotbank sowie steuerliche Unsicherheiten.

Derivaterisiko: Der Fonds kann DFI zum Zwecke der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements einsetzen, wie im obigen Abschnitt „Derivate“ unter „Zugelassene Anlagen“ beschrieben. Der Einsatz von DFI durch einen Fonds birgt Risiken, die sich von den Risiken einer direkten Anlage in Wertpapieren unterscheiden und möglicherweise höher als diese sind.

Screening-Risiken: Es besteht ein Risiko von Fehlern seitens des Indexanbieters, etwa eine falsche Beurteilung

der in der Anlagepolitik beschriebenen Screening-Kriterien und/oder die Aufnahme der falschen/der Ausschluss der richtigen Komponenten im Screening-Prozess. ESG-Scoring und -Screening unterliegen inhärenten methodischen Grenzen. Eine Beurteilung von ESG-Kriterien durch einen Index basiert auf den von Dritten bereitgestellten Daten. Diese Beurteilungen sind von Informationen und Daten abhängig, die unvollständig, unrichtig oder nicht verfügbar sein können, was zu einer falschen Beurteilung der ESG-Performance eines Emittenten führen kann. Insbesondere können Unstimmigkeiten, Ungenauigkeiten oder mangelnde Verfügbarkeit erforderlicher ESG-Daten auftreten, insbesondere, wenn diese von externen Datenlieferanten herausgegeben werden. Diese Grenzen können insbesondere Probleme umfassen im Zusammenhang mit:

- fehlenden oder unvollständigen Daten von Unternehmen (beispielsweise in Bezug auf deren Fähigkeit, ihre Nachhaltigkeitsrisiken zu managen), die als Eingabedaten für ein Scoring-Modell herangezogen wurden;
- die Quantität und die Qualität von zu verarbeitenden ESG-Daten;
- die Ermittlung relevanter Faktoren für die ESG-Analyse.

Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken: Die Einbeziehung von Nachhaltigkeitsrisiken seitens des Index gewährleistet nicht die Minderung eines oder aller Nachhaltigkeitsrisiken. Eine durch ein Nachhaltigkeitsrisiko beeinflusste Verschlechterung im Finanzprofil einer zugrunde liegenden Anlage kann eine entsprechend negative Auswirkung auf den Nettoinventarwert und/oder die Wertentwicklung des investierenden Fonds haben.

SFDR – Fondsklassifizierungsrisiko: Die Umsetzung des SFDR erfolgt schrittweise ab dem 10. März 2021 und führt neue Offenlegungspflichten für Teilnehmer der Finanzmärkte ein. Zum Datum dieses Prospekts wurden die technischen Regulierungsstandards zur Umsetzung (Stufe 2) für die SFDR von der Europäischen Kommission verabschiedet und gelten ab dem 1. Januar 2023, aber einige von der SFDR eingeführten Konzepte sind derzeit nicht Gegenstand einheitlicher Durchführungsstandards, lokaler Leitlinien oder bestehender Marktpraxis. Der Fonds wurde in gutem Glauben auf der Grundlage der derzeit verfügbaren entsprechenden Informationen bewertet und klassifiziert. Da diese Standards und Vorgaben sich entwickeln, unterliegen die in diesem Nachtrag und auf der Website angegebenen SFDR-bezogenen Informationen und Klassifizierungen gemäß Artikel 8 Änderungen und können nicht mehr zutreffen.

Risiken im Zusammenhang mit Anteilklassen: Es besteht keine Haftungstrennung zwischen den Anteilklassen des Fonds. Auch wenn der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter bestrebt sein werden sicherzustellen, dass Gewinne/Verluste aus und die Kosten von DFI, die in Zusammenhang mit einer Währungsabsicherungsstrategie eingesetzt werden, auch nur dieser Klasse zugerechnet werden, können durch diese Transaktionen Verbindlichkeiten für andere Klassen entstehen.

Währungsabsicherungsrisiko: Absicherungsmaßnahmen bieten bisweilen keine optimale Abstimmung zwischen dem Absicherungsgeschäft und dem abzusichernden Risiko. Es kann nicht garantiert werden, dass die Absicherungsmaßnahmen des Fonds erfolgreich sein werden. Da der Zweck von Währungsabsicherungen darin besteht, durch Wechselkursschwankungen verursachte Verluste zu reduzieren oder zu eliminieren, können auch die Gewinne reduziert bzw. eliminiert werden, wenn die Währung, auf die die Vermögenswerte des Fonds lauten, steigt.

Anlegerprofil

Die typischen Anleger des Fonds werden voraussichtlich institutionelle Investoren, Intermediäre und Privatanleger sein, die ein kurz-, mittel- oder langfristiges Engagement in der Wertentwicklung der Aktienmärkte von Industrie- und Schwellenländern weltweit suchen und bereit sind, die mit einer Anlage dieser Art verbundenen Risiken und die erwartete hohe Volatilität des Fonds in Kauf zu nehmen.

Zeichnungen, Rücknahmen und Umtausch

Anleger können Fondsanteile an jedem Handelstag zum handelbaren NIW zeichnen oder zurückgeben, unter angemessener Berücksichtigung der Kosten und Gebühren und gemäß den Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts.

Die Gegenleistung für Zeichnungen muss in Form liquider Mittel bis zum Abrechnungszeitpunkt eingehen. Für Rücknahmen ist ein schriftlicher, vom Anteilinhaber unterzeichneter Rücknahmeantrag erforderlich, der am jeweiligen Handelstag vor dem Handelsschluss bei der Verwaltungsstelle eingehen muss. Der Handel gegen Sachwerten durch die Anteilinhaber ist nicht zulässig.

Für Informationen über Anteilsumschichtungen sollten die Anteilinhaber die Bestimmungen im Abschnitt „**Kauf- und Verkaufsinformationen**“ des Prospekts lesen.

Erstausgabezeitraum

Anteile an dem Fonds, die zum Datum dieses Nachtrags nicht aufgelegt sind, werden ab dem 6. April 2023 um 9:00 Uhr (irischer Zeit) bis zum 5. Oktober 2023 um 15:00 Uhr (irischer Zeit) oder einem früheren oder späteren Zeitpunkt, den der Verwaltungsrat festlegt und der Zentralbank mitteilt, zur Verfügung stehen (der „**Erstausgabezeitraum**“). Der Erstausgabepreis wird in etwa 10 in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, unter einer angemessenen Berücksichtigung von Kosten und Gebühren oder anderen, vom Anlageverwalter und/oder vom Unteranlageverwalter festgelegten Beträgen, wie dem Anleger vor einer Anlage mitgeteilt, entsprechen. Nach Ablauf des Erstausgabezeitraums werden Anteile zum handelbaren Nettoinventarwert ausgegeben.

SFDR-Anhang**ANHANG II****Vorlage – Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Name des Produkts: SPDR MSCI ACWI Climate Paris Aligned UCITS ETF (der „Fonds“)

Unternehmenskennung:
549300B4UT29U73NOW48

Ökologische und/oder soziale Merkmale**Werden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?**

Ja

Nein

- Es wird damit ein Mindestanteil an **nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___ %

Es werden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt werden, enthält es einen Mindestanteil von 0 % an nachhaltigen Investitionen

- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

- Es wird damit ein Mindestanteil an **nachhaltigen Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___ %

Es werden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

Welche ökologischen und/oder sozialen Merkmale werden mit diesem Finanzprodukt beworben?

Die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale entsprechen denen des MSCI ACWI Climate Paris Aligned Index (der „Index“), den der Fonds nachbildet. Der Index zielt darauf ab, die Wertentwicklung einer Untergruppe von Aktienwerten von Unternehmen innerhalb des MSCI ACWI Index (der „übergeordnete Index“) abzubilden, um die Partizipation an Übergangs- und physischen Klimarisiken zu verringern und gleichzeitig Chancen zu nutzen, die sich aus dem Übergang zu einer kohlenstoffärmeren Wirtschaft ergeben. Der Index strebt eine Übereinstimmung mit dem Übereinkommen von Paris an (das „Übereinkommen von Paris“), das im Rahmen des Rahmenübereinkommens der Vereinten Nationen über Klimaänderungen angenommen wurde.



Nachhaltigkeitsindikatoren messen, wie die durch das Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Welche Nachhaltigkeitsindikatoren werden zur Messung der Erreichung der einzelnen ökologischen oder sozialen Merkmale, die durch dieses Finanzprodukt beworben werden, herangezogen?

Das Erreichen der relevanten Merkmale wird anhand der unten beschriebenen Indikatoren bewertet. Die Ziele des Index sind:

- eine Reduzierung der gesamten Treibhausgasintensität (THG) im Vergleich zum übergeordneten Index;
- eine Mindestdekarbonisierungsrate für die Reduzierung der THG-Emissionsintensität pro Jahr

- ein Engagement in Sektoren mit starken Auswirkungen auf den Klimawandel, das mindestens dem des übergeordneten Index entspricht, um den Zielen des Übereinkommens von Paris zu entsprechen, das ein Engagement in Sektoren vorsieht, die ihre THG-Emissionen aktiv reduzieren sollten.

Der Index berücksichtigt:

- ein erhöhtes Engagement in Unternehmen, die Emissionsreduktionsziele und ihre jährlichen Emissionen veröffentlichen sowie ihre THG-Emissionsintensität reduzieren;
- den Beitrag zur Verringerung der gewichteten durchschnittlichen potenziellen Emissionsintensität im Vergleich zum übergeordnetem Index;
- den Beitrag zu einer höheren Gesamtbewertung für den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft (Low Carbon Transition, LCT) im Vergleich zum übergeordneten Index (d. h. ein geringeres Gesamtengagement in Unternehmen, die mit LCT-Risiken konfrontiert sind, und/oder ein höheres Gesamtengagement in Unternehmen, die mit LCT im Zusammenhang stehende Chancen bieten können), wie vom Indexanbieter festgelegt;
- die Verringerung des physischen Risikos aufgrund extremer Wetterereignisse im Vergleich zum übergeordneten Index
- den Beitrag zu einem erhöhten Gesamtengagement in Unternehmen mit einem Mindestverhältnis von „grünen“ zu „braunen“ Umsätzen im Vergleich zum übergeordnetem Index. Grüne Umsätze sind diejenigen, die die Unternehmensumsätze aus Produkten und Dienstleistungen widerspiegeln, die das Potenzial haben, zu einem Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft beizutragen, während braune Umsätze das Potenzial haben, die Umwelt zu schädigen und den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft zu verschlechtern (weitere Informationen zur Bedeutung von grünen und braunen Umsätzen und deren Berechnung finden Sie in der Indexmethodik);
- den Beitrag zu höheren grünen Gesamtumsätzen im Vergleich zum übergeordnetem Index und
- die Liquiditäts- und Diversifizierungsdeckelungen auf Ebene der Komponenten.

Welches sind die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigten werden sollen, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.

Inwiefern werden die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigten werden sollen, keinem der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Anlageziele erheblich schaden?

Nicht anwendbar

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht anwendbar

Wie stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Nicht anwendbar

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigelegt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Ja,



Der Fonds strebt eine Reduzierung der durch die zugrunde liegenden Anlagen verursachten negativen externen Effekte an. Er berücksichtigt in diesem Zusammenhang die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (Principal Adverse Impacts, „PAI“) auf Nachhaltigkeitsfaktoren, indem er normbasierte ESG-Filter innerhalb des Index anwendet. Der Fonds berücksichtigt insbesondere:

- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze
- Engagement in kontroversen Waffen

Weitere Informationen zu den PAI finden Sie in den regelmäßigen Fondsberichten.

Nein

Welche Anlagestrategie wird mit diesem Finanzprodukt verfolgt?

 Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nachzubilden und dabei so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der Index-Wertentwicklung zu minimieren.

Der Index zielt darauf ab, die Wertentwicklung einer Untergruppe von Aktienwerten von Unternehmen innerhalb des übergeordneten Index widerzuspiegeln, die in Übereinstimmung mit der Indexmethodik ausgewählt und gewichtet werden. Die Indexmethodik zielt darauf ab, die Partizipation an Übergangs- und physischen Klimarisiken zu verringern und gleichzeitig Chancen zu nutzen, die sich aus dem Übergang zu einer kohlenstoffärmeren Wirtschaft ergeben. Sie strebt eine Übereinstimmung mit dem Übereinkommen von Paris an. Der übergeordnete Index misst die Wertentwicklung von Aktien von Unternehmen mit großer und mittlerer Marktkapitalisierung aus Industrie- und Schwellenländern. Der Index soll die in der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1818 der Kommission für die Methodik von Referenzwertindizes, die auf die Ziele des Übereinkommens von Paris abgestimmt sind, festgelegten Mindeststandards für die auf das Übereinkommen von Paris abgestimmten EU-Referenzwerte übertreffen. Der Index schließt bestimmte Unternehmen aufgrund ihrer Beteiligung an den folgenden kontroversen Geschäftsaktivitäten aus: kontroverse Waffen, Tabak, Öl und Gas sowie Abbau und Verstromung von Kraftwerkskohle, wobei in der Indexmethodik näher erläutert wird, wie der Indexanbieter eine „Beteiligung“ definiert. Der Index schließt zudem Unternehmen aus, die vom Indexanbieter als in Kontroversen verwickelt identifiziert werden, die negative ESG-Auswirkungen auf ihre Geschäftstätigkeit und/oder Produkte und Dienstleistungen haben. Die Ausschlüsse basieren auf einem MSCI ESG Controversy Score („MSCI ESG Controversy Score“).

Der Anlageverwalter und/oder der Unteranlageverwalter für den Fonds investiert anhand der Strategie stratifizierter Stichproben, wie sie im Abschnitt „Anlageziele und Anlagepolitik – Indexnachbildende Fonds“ näher beschrieben ist, überwiegend in die Indexkomponenten, richtet sich dabei aber jederzeit nach den im Prospekt angegebenen Anlagebeschränkungen.

Worin bestehen die verbindlichen Elemente der Anlagestrategie, die für die Auswahl der Investitionen zur Erfüllung der beworbenen ökologischen oder sozialen Ziele verwendet werden?

Die Anlagepolitik des Fonds ist es, die Wertentwicklung des Index nachzubilden. Mindestens 90 % des Fondsvermögens werden in Wertpapiere investiert, die im Index vertreten sind, während der Indexanbieter auf alle Indexkomponenten ESG-Ratings anwendet. Der Index schließt bestimmte Unternehmen aufgrund ihrer Beteiligung an den folgenden kontroversen Geschäftsaktivitäten aus: kontroverse Waffen, Tabak, Öl und Gas sowie Abbau und Verstromung von Kraftwerkskohle, wobei in der Indexmethodik näher erläutert wird, wie der Indexanbieter eine „Beteiligung“ definiert. Der Index schließt zudem Unternehmen aus, die vom Indexanbieter als in Kontroversen verwickelt identifiziert werden, die negative ESG-Auswirkungen auf ihre Geschäftstätigkeit und/oder Produkte und Dienstleistungen haben. Die Ausschlüsse basieren auf einem MSCI ESG Controversy Score („MSCI ESG Controversy Score“).

Um welchen Mindestsatz wird der Umfang der vor der Anwendung dieser Anlagestrategie in Betracht gezogenen Investitionen reduziert?

Der Fonds schließt Anlagen in Emittenten aus, wie in der Anlagestrategie und den verbindlichen Anforderungen vorstehend dargelegt, sieht jedoch keinen festgelegten Mindestsatz vor, um den Umfang der Anlagen zu reduzieren.

Wie werden die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung der Unternehmen, in die investiert wird, bewertet?

Unternehmen, die nach Ansicht des Indexanbieters nicht gegen die UNGC-Grundsätze verstößen, gelten als Unternehmen mit einer guten Unternehmensführung. Informationen zu den Methoden, die bei der Konstruktion des Index verwendet werden, sowie weitere Informationen zu den Ausschlusskriterien und Datenquellen finden Sie in der Beschreibung der Indexmethodik von MSCI, die unter folgendem Link abrufbar ist:

https://www.msci.com/eqb/methodology/meth_docs/MSCI_Climate_Paris_Aligned_Index_es.pdf

Die Anlagestrategie dient als Richtschnur für Investitionsentscheidungen, wobei bestimmte Kriterien wie beispielsweise Investitionsziele oder Risikotoleranz berücksichtigt werden.

Die Verfahrensweisen einer **guten Unternehmensführung** umfassen solide Managementstrukturen, die Beziehungen zu den Arbeitnehmern, die Vergütung von Mitarbeitern sowie die Einhaltung der Steuervorschriften.



Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Welche Vermögensallokation ist für dieses Finanzprodukt geplant?

Ökologische und soziale Merkmale werden durch die Verwendung von Filtern und Best-in-Class-Kriterien innerhalb des Index beworben. Mindestens 90 % des Fondsvermögens werden in Wertpapiere investiert, die im Index enthalten sind und sich an ökologischen und/oder sozialen Merkmalen orientieren, während der Indexanbieter ESG-Ratings für alle Indexkomponenten anwendet. Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen im Sinne der SFDR oder der Taxonomie-Verordnung. Der Fonds kann nach dem Ermessen des Anlageverwalters 10 % seines Vermögens in Form von Zahlungsmitteln oder Zahlungsmitteläquivalenten und Derivaten halten, die zur Währungsabsicherung und für ein effizientes Portfoliomangement eingesetzt werden, und die in der nachstehenden Tabelle unter #2 Sonstige eingestuft würden. Diese Vermögenswerte werden nicht an ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet, und es werden auch keine ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen getroffen. Der Fonds verpflichtet sich nicht, nachhaltige Investitionen im Sinne der SFDR oder der EU-Taxonomie-Verordnung zu tätigen. Das Portfolio des Fonds setzt sich überwiegend aus Wertpapieren zusammen, die den oben und in der Indexmethode beschriebenen ESG-Standards entsprechen (wodurch sichergestellt wird, dass keine Emittenten im Portfolio enthalten sind, deren Aktivitäten dieses Ziel erheblich beeinträchtigen würden).

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

Umsatzerlöse, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Investitionsausgaben (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

Betriebsausgaben (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Investitionen

#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale 90 %

#2 Sonstige: 10 %

#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigten wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Inwiefern werden durch den Einsatz von Derivaten die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht?

Soweit der Fonds ausschließlich zum Zweck der Währungsabsicherung und des effizienten Portfoliomanagements derivative Finanzinstrumente einsetzt, werden diese nicht zur Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet.



In welchem Mindestmaß sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Obwohl dieser Fonds ökologische Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR bewirbt, verpflichtet er sich gegenwärtig nicht dazu, in „nachhaltige Investitionen“ im Sinne der Taxonomie-Verordnung zu investieren. Daher verpflichtet sich der Fonds nicht, mehr als 0 % seines Nettoinventarwerts in Anlagen zu investieren, die der Taxonomie-Verordnung entsprechen. Daher ist zu beachten, dass dieser Fonds die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der Taxonomie-Verordnung nicht berücksichtigt. Es ist daher keine Ausrichtung des Portfolios an der Taxonomie-Verordnung geplant. Aus diesem Grund gilt der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ für keine der Anlagen dieses Fonds und

es ist keine Ausrichtung an der Taxonomie-Verordnung beabsichtigt.

Wird mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichtend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionen aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

Ja: In fossile Brennstoffe In Kernenergie
Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomie-Konformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*

Taxonomiekonform (kein fossiles Gas und keine Kernenergie)	0%
Nicht taxonomiekonform	100%

2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*

Taxonomiekonform (kein fossiles Gas und keine Kernenergie)	0%
Nicht taxonomiekonform	100%

Diese Grafik zeigt 100 % der gesamten Anlagen.

*** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.**

Wie hoch ist der Mindestanteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermögliche Tätigkeiten?

Der Fonds verpflichtet sich zu einem Mindestanteil an Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichen Tätigkeiten.

Wie hoch ist der Mindestanteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind?

Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.

Wie hoch ist der Mindestanteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht anwendbar.

Welche Investitionen fallen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Fonds kann nach dem Ermessen des Anlageverwalters einen Teil seines Vermögens in Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten sowie in Derivaten halten, die zur Währungsabsicherung und für ein effizientes Portfoliomangement eingesetzt werden und die in der vorstehenden Tabelle unter #2 Sonstige eingestuft werden. Diese Vermögenswerte werden nicht an ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet, und es werden auch keine ökologischen oder sozialen Schutzmaßnahmen getroffen.

Wurde ein spezifischer Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist?

Der Fonds bildet die Wertentwicklung des MSCI ACWI Climate Paris Aligned Index (oder eines anderen vom Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit festgelegten Index, der im

¹Mit fossilem Gas und/oder Kernenergie verbundene Tätigkeiten entsprechen nur dann der EU-Taxonomie, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für mit fossilem Gas und Kernenergie verbundenen Tätigkeiten, die der EU-Taxonomie entsprechen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Informationsklassifizierung: Allgemeines

12

Wesentlichen denselben Markt nachbildet wie der Index) so genau wie möglich nach und strebt danach, so weit wie möglich die Tracking Difference zwischen der Wertentwicklung des Fonds und der des Index zu minimieren.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Inwiefern ist der Referenzwert kontinuierlich auf die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet?

Die Indexmethodik sieht eine laufende Überprüfung und jährliche Neugewichtung vor, bei der das Universum des übergeordneten Index auf die oben dargelegten ESG-Ausschlusskriterien überprüft wird.

Wie wird die kontinuierliche Ausrichtung der Anlagestrategie auf die Indexmethodik sichergestellt?

Der Fonds wird halbjährlich in Übereinstimmung mit der Häufigkeit der Neugewichtung des Index ebenfalls neu gewichtet.

Wie unterscheidet sich der bestimmte Index von einem relevanten breiten Marktindex?

Der bestimmte Index implementiert Ausschlüsse und Änderungen der Indexgewichtungen gegenüber dem relevanten breiten Marktindex, die von den ESG-Merkmalen der Unternehmen abhängen, wobei sowohl ESG-Ratings als auch die Beteiligung an bestimmten kontroversen Geschäftsaktivitäten berücksichtigt werden, wie vom Indexanbieter MSCI festgelegt. Informationen zur Indexmethodik, die bei der Konstruktion des Index verwendet wird, sowie weitere Informationen zu den Ausschlusskriterien und Datenquellen finden Sie in der Beschreibung der Indexmethodik von MSCI.

Wo kann die Methode zur Berechnung des bestimmten Indexes eingesehen werden?

https://www.msci.com/eqb/methodology/meth_docs/MSCI_Climate_Paris_Aligned_Indexes.pdf

Wo kann ich im Internet weitere produktspezifische Informationen finden?

Weitere produktspezifische Informationen sind abrufbar unter:

[Anlagen in SPDR Exchange Traded Funds \(ETFs\) \(ssga.com\)](#)



SPDR MSCI ACWI Climate Paris Aligned UCITS ETF

„MSCI ACWI Climate Paris Aligned Index“ ist eine Marke von MSCI und deren Konzerngesellschaften und wurde zur Verwendung durch die State Street Corporation für bestimmte Zwecke lizenziert.

Der SPDR MSCI ACWI CLIMATE PARIS ALIGNED UCITS ETF, der auf dem MSCI ACWI Climate Paris Aligned Index basiert, wurde von MSCI nicht im Hinblick auf seine Rechtmäßigkeit oder Eignung überprüft und wird nicht von MSCI begeben, unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben.

DER SPDR MSCI ACWI CLIMATE PARIS ALIGNED UCITS ETF WIRD VON MSCI INC. WEDER UNTERSTÜTZT NOCH EMPFOHLEN, VERKAUFT ODER BEWORBEN. IHREN KONZERNGESELLSCHAFTEN, IHREN INFORMATIONSLIEFERANTEN ODER ANDEREN MIT DER ZUSAMMENSTELLUNG, BERECHNUNG ODER SCHAFFUNG EINES MSCI INDEX BEFASSTEN ODER VERBUNDENEN PARTEIEN (ZUSAMMEN DIE „MSCI-PARTEIEN“) NICHT GESPONSERT, EMPFOHLEN, VERKAUFT ODER GEFÖRDERT. DIE MSCI-INDIZES STEHEN IM AUSSCHLIESSLICHEN EIGENTUM VON MSCI. MSCI UND DIE NAMEN DER MSCI-INDIZES SIND MARKEN VON MSCI ODER IHRER KONZERNGESELLSCHAFTEN UND WURDEN ZUR VERWENDUNG ZU BESTIMMTEN ZWECKEN DURCH STATE STREET CORPORATION LIZENZIERT. KEINE DER MSCI-PARTEIEN GIBT EINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE ZUSICHERUNG ODER GEWÄHRLEISTUNG GEGENÜBER DEM EMITTENTEN ODER DEN GESELLSCHAFTERN DES SPDR MSCI ACWI CLIMATE PARIS ALIGNED UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN AB HINSICHTLICH DER RATSAMKEIT EINER ANLAGE IN FONDS IM ALLGEMEINEN ODER IM SPDR MSCI ACWI CLIMATE PARIS ALIGNED UCITS ETF IM BESONDEREN ODER DER FÄHIGKEIT EINES MSCI-INDEX, DIE JEWELIGE AKTIENMARKTENTWICKLUNG ABZUBILDEN. MSCI ODER IHRE KONZERNGESELLSCHAFTEN SIND DIE LIZENZGEBER BESTIMMTER MARKEN UND HANDELSNAMEN SOWIE DER MSCI-INDIZES, DIE VON MSCI OHNE BERÜKSICHTIGUNG DES SPDR MSCI ACWI CLIMATE PARIS ALIGNED UCITS ETF ODER DES EMITTENTEN ODER DER GESELLSCHAFTER DES SPDR MSCI ACWI CLIMATE PARIS ALIGNED UCITS ETF ODER ANDERER PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN FESTGELEGT, ZUSAMMENGESTELLT UND BERECHNET WERDEN. KEINE DER MSCI-PARTEIEN UNTERLIEGT EINER VERPFlichtUNG, BEI DER FESTLEGUNG, ZUSAMMENSETTUNG ODER BERECHNUNG DER MSCI-INDIZES DIE BELANGE DES EMITTENTEN ODER DER GESELLSCHAFTER DES SPDR MSCI ACWI CLIMATE PARIS ALIGNED UCITS ETF ODER ANDERER PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN ZU BERÜCKSICHTIGEN. KEINE DER MSCI-PARTEIEN IST FÜR DIE FESTLEGUNG DES AUSGABEZEPUNKTS, DER AUSGABEPREISE ODER DES AUSGABEUMFANGS DES SPDR MSCI ACWI CLIMATE PARIS ALIGNED UCITS ETF ODER DIE FESTLEGUNG ODER BERECHNUNG DER GLEICHUNG, ANHAND DERER, ODER DES BETRAGES, GEGEN DEN ANTEILE DES SPDR MSCI ACWI CLIMATE PARIS ALIGNED UCITS ETF ZURÜCKGEgeben WERDEN KÖNNEN, VERANTWORTLICH ODER IST DARAN BETEILIGT. WEITERHIN UNTERLIEGT KEINE DER MSCI-PARTEIEN EINER VERPFlichtUNG GEGENÜBER DEM EMITTENTEN ODER DEN GESELLSCHAFTERN DES SPDR MSCI ACWI CLIMATE PARIS ALIGNED UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN IM ZUSAMMENHANG MIT DER VERWALTUNG, DEM VERTRIEB ODER DEM ANGEBOT DES SPDR MSCI ACWI CLIMATE PARIS ALIGNED UCITS ETF.

OBWOHL MSCI INFORMATIONEN ZUR AUFNAHME IN DIE MSCI-INDIZES ODER ZUR VERWENDUNG BEI DEREN BERECHNUNG VON QUELLEN ERHÄLT, DIE MSCI ALS VERLÄSSLICH BETRACHTET, GEWÄHRLEISTET KEINE DER MSCI-PARTEIEN DIE ECHTHEIT, RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT EINES MSCI-INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN. KEINE DER MSCI-PARTEIEN GIBT EINE AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNG AB HINSICHTLICH DER VOM EMITTENTEN DES SPDR MSCI ACWI CLIMATE PARIS ALIGNED UCITS ETF, DEN GESELLSCHAFTERN DES SPDR MSCI ACWI CLIMATE PARIS ALIGNED UCITS ETF ODER ANDEREN PERSONEN ODER EINRICHTUNGEN DURCH DIE VERWENDUNG EINES MSCI-INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN ZU ERZIELENDEN ERGEBNISSE. KEINE DER MSCI-PARTEIEN HAFTET FÜR FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN IN VERBINDUNG MIT MSCI-INDIZES ODER DARIN ENTHALTENEN DATEN. HINSICHTLICH DER MSCI-INDIZES UND DER DARIN ENTHALTENEN DATEN GIBT KEINE DER MSCI-PARTEIEN AUSDRÜCKLICHE ODER STILLSCHWEIGENDE GEWÄHRLEISTUNGEN IRGENDERART, AB UND HIERMIT SCHLIESSEN DIE MSCI-PARTEIEN AUSDRÜCKLICH JEGLICHE GEWÄHRLEISTUNG FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT UND EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK AUS. UNBESCHADET DES VORSTEHENDEN HAFTEN DIE MSCI-PARTEIEN IN KEINEM FALL FÜR UNMITTELBARE, MITTELBARE ODER KONKRETE SCHÄDEN, STRAFSCHADENERSATZ, FOLGESCHÄDEN ODER ANDERE SCHÄDEN (EINSCHLIESSLICH ENTGANGENER GEWINNE), SELBST WENN SIE VON DER MÖGLICHKEIT SOLCHER SCHÄDEN UNTERRICHTET WURDEN.

Zum Datum dieses Nachtrags nutzt der Fonds (im Sinne der Benchmark-Verordnung) die folgende Benchmark von MSCI Limited:

MSCI ACWI Climate Paris Aligned Index.

Zum Datum des Nachtrags ist kein Unternehmen von MSCI Limited im ESMA-Register gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung eingetragen. MSCI Limited ist und bleibt von der britischen Finanzaufsicht (Financial Conduct Authority; „FCA“) als britischer Benchmark-Administrator zugelassen und reguliert (und ist im Finanzdienstleistungsregister der FCA (Financial Services Register) zu finden); MSCI Limited wird jedoch in Bezug auf die EU als in einem Drittstaat angesiedelter britischer Administrator betrachtet und wird gemäß Artikel 36 der Benchmark-Verordnung nicht im ESMA-Register eingetragen, sofern nicht und bis die EU eine Äquivalenzentscheidung bezogen auf das Vereinigte Königreich trifft oder bis MSCI der Status „Übernahme“ oder „Anerkennung“ gewährt wird.

„SPDR®“ ist eine eingetragene Marke von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“) und wurde zur Benutzung durch die State Street Corporation lizenziert. Kein von der State Street Corporation oder ihren Konzerngesellschaften angebotenes Finanzprodukt wird von S&P oder ihren Konzerngesellschaften unterstützt, empfohlen, verkauft oder beworben, und S&P und ihre Konzerngesellschaften geben keinerlei Erklärungen, Zusicherungen oder Gewährleistungen hinsichtlich der Zweckmäßigkeit des Kaufs, Verkaufs oder des Haltens von Anteilen an solchen Produkten ab. Standard & Poor's®, S&P®, SPDR®, S&P 500® sind Marken der Standard & Poor's Financial Services LLC, und der State Street Corporation wurden für ihre Verwendung Lizenzen erteilt.