

SPDR® Bloomberg SASB U.S. High Yield Corporate ESG UCITS ETF (Dist)

Informationsblatt

31 Oktober 2024

**Umwelt, Soziales &
Gesellschaft**

★★★★

Morningstar Rating™

30 September 2024



Anlageziel des Fonds

Das Ziel des Fonds ist die Abbildung der Wertentwicklung des festverzinslichen, in US-Dollar notierten Marktes für hochverzinsliche Unternehmensanleihen.

Indexbeschreibung

Der Index ist ein hochverzinslicher, festverzinslicher, in US-Dollar notierter Vergleichsindex, der seinen R-Faktor-Wert von State Street Global Advisors optimiert. Der Index wählt Wertpapiere mit Berechtigung für den Bloomberg U.S. High Yield Corporate Index aus und gewichtet sie mithilfe eines Optimierungsverfahrens bei gleichzeitiger Kontrolle des aktiven Gesamttrisikos. Bestimmte Emittenten werden vom Index auf Grundlage ihrer ESG-Charakteristiken ausgeschlossen, wobei sowohl ihr ESG-Rating als auch, wie in der Indexmethode erläutert, ihre Beteiligung an bestimmten umstrittenen Geschäftsaktivitäten berücksichtigt werden.

Steuerstatus

Standardgemäß ist die SSGA bestrebt, alle geltenden steuerlichen Berichtspflichten für alle SPDR ETFs in den folgenden Ländern einzuhalten. Anmeldungen erfolgen je nach der Zeitskala, die von der jeweiligen Steuerbehörde vorgegeben wird, das ganze Jahr über: Großbritannien, Deutschland, Österreich, Schweiz.

Länder mit Vertriebszulassung

Spanien, Schweiz, Schweden, Österreich, Norwegen, Niederlande, Luxemburg, Italien, Irland, Großbritannien, Frankreich, Finnland, Deutschland, Dänemark

Fondsdaten

| | |
|-----------------------|--|
| ISIN | IE00B99FL386 |
| Benchmark | Bloomberg SASB US Corporate High Yield ESG Ex-Controversies Select Index |
| Index Ticker | I36569US |
| Index-klassifizierung | Gesamtertrag |
| Anzahl An Titeln | 985 |

Schlüsselfaktoren

| | |
|-------------------------------------|--|
| Auflagedatum | 19-Sep-2013 |
| Share Class Währung | USD |
| Fonds — Basiswährung | USD |
| TER | 0,30% |
| Ertragsverwendung | Halbjährliche Ausschüttungen |
| Replikationsmethode | Stratifizierte Stichproben (stratified sampling) |
| UCITS-konform | Ja |
| SFDR-Fondsklassifizierung | SFDR – Artikel 8 |
| Domizil | Irland |
| Investment Manager | State Street Global Advisors Europe Limited |
| Unteranlageverwalter | State Street Global Advisors Trust Company |
| Fonds-Umbrella | SSGA SPDR ETFs Europe I plc |
| Volumen Anteilsklasse (Mio.) | US\$184,02 |
| Volumen aller Anteilsklassen (Mio.) | US\$407,72 |
| ISA berechtigt | Ja |
| SIPP berechtigt | Ja |
| PEA berechtigt | Keine |

Vor dem 29 Oktober 2021 war der Fonds unter der Bezeichnung SPDR Bloomberg Barclays 0-5 Year U.S. High Yield Bond UCITS ETF (Dist) bekannt und bildete den Bloomberg Barclays U.S. High Yield 0-5 Year (ex 144a) Bond Index nach. Indexänderung „Index“ spiegelt die verknüpften Wertentwicklungsrenditen des Bloomberg SASB US Corporate High Yield ESG Ex-Controversies Select Index und des Bloomberg U.S. High Yield 0-5 Year (ex 144a) Bond Index wider. Die Indexwertentwicklungen spiegeln den Bloomberg U.S. High Yield 0-5 Year (ex 144a) Bond Index von der Fondsauflegung bis zum Oktober 29, 2021 und den Bloomberg SASB US Corporate High Yield ESG Ex-Controversies Select Index gültig ab dem Oktober 29, 2021 bis heute wider.

Notierung

| Börse | Börsenticker | Handelswährung | iNAV Code | Bloomberg Code | Reuters Code | SEDOL Code |
|-----------------------|--------------|----------------|-----------|----------------|--------------|------------|
| Deutsche Börse* | SYBK | EUR | INSYBKE | SYBK GY | SYBK.DE | B7XBGS8 |
| London Stock Exchange | JNKS | GBP | INSYBKP | JNKS LN | JNKS.L | BCW3HJ8 |
| London Stock Exchange | SJNK | USD | INSYBK | SJNK LN | SJNK.L | B99FL38 |
| Borsa Italiana | SJNK | EUR | INSYBKE | SJNK IM | SJNK.MI | BGQV279 |
| SIX Swiss Exchange | SJNK | CHF | INSYBKC | SJNK SE | SJNK.S | BGQV280 |

*Primary Listing

Wertentwicklung

| | Index | Fonds vor Kosten (brutto) | Differenz | Fonds nach Kosten (netto) | Differenz |
|--|-------|---------------------------|-----------|---------------------------|-----------|
|--|-------|---------------------------|-----------|---------------------------|-----------|

Annualisierte Renditen (%)

| | | | | | |
|--------------|-------|-------|------|-------|-------|
| 1 Jahr | 18,24 | 18,49 | 0,25 | 18,13 | -0,11 |
| 3 Jahre | 3,42 | 3,64 | 0,21 | 3,33 | -0,10 |
| 5 Jahre | 4,33 | 4,50 | 0,17 | 4,16 | -0,17 |
| 10 Jahre | 4,34 | 4,38 | 0,04 | 4,00 | -0,33 |
| Seit Auflage | 4,36 | 4,36 | 0,00 | 3,98 | -0,38 |

Kumulative Wertentwicklung (%)

| | | | | | |
|--------------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 1 Monat | -0,39 | -0,38 | 0,02 | -0,40 | -0,01 |
| 3 Monate | 3,24 | 3,16 | -0,08 | 3,08 | -0,16 |
| 1 Jahr | 18,24 | 18,49 | 0,25 | 18,13 | -0,11 |
| 2 Jahre | 25,20 | 26,17 | 0,97 | 25,41 | 0,21 |
| 3 Jahre | 10,62 | 11,31 | 0,69 | 10,32 | -0,31 |
| 5 Jahre | 23,59 | 24,61 | 1,01 | 22,62 | -0,98 |
| 10 Jahre | 52,91 | 53,51 | 0,60 | 48,08 | -4,83 |
| Seit Auflage | 60,68 | 60,71 | 0,03 | 54,33 | -6,34 |

Jahresrendite (%)

| | | | | | |
|------|--------|--------|-------|--------|-------|
| 2024 | 9,00 | 9,12 | 0,12 | 8,85 | -0,15 |
| 2023 | 12,12 | 12,83 | 0,71 | 12,49 | 0,37 |
| 2022 | -10,32 | -10,40 | -0,07 | -10,67 | -0,34 |
| 2021 | 5,68 | 5,37 | -0,31 | 5,06 | -0,62 |
| 2020 | 4,77 | 5,38 | 0,61 | 4,96 | 0,19 |
| 2019 | 9,85 | 9,75 | -0,11 | 9,31 | -0,54 |

| | Fonds (%) |
|--|-----------|
| Standardabweichung (3 Jahre) | 8,77 |
| Annualisierter Tracking Error (3 Jahre) | 0,32 |

Die in der Vergangenheit erzielte Performance ist kein Indikator für die zukünftige Performance. In den vorliegenden Performancezahlen sind die Kommissionen und Kosten für die Ausgabe und Rücknahme sowie den Kauf und Verkauf von Anteilen nicht berücksichtigt. Wenn die Performance auf Basis des Nettoinventarwertes in einer anderen Währung als der Abrechnungswährung der kollektiven Kapitalanlage kalkuliert wird, kann der Wert infolge von Wechselkurschwankungen steigen oder fallen.

Wird der Fonds gemäß seinem offiziellen Nettoinventarwert (NIW)-Kalender geschlossen, doch es sind dessen ungeachtet Preise für einen maßgeblichen Teil der zugrunde liegenden Wertpapiere ermittelbar, wird ein technischer NIW berechnet. Die hierin angegebene frühere Wertentwicklung wurde daher erforderlichenfalls auf Grundlage eines technischen NIW und des offiziellen NIW des Fonds zu jedem anderen Geschäftstag des betreffenden Zeitraums berechnet.

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.

Merkmale

| | |
|--|--------|
| Anzahl der Vermögenswerte | 681 |
| Durchschnittliche Restlaufzeit in Jahren | 4,90 |
| Effektive Konvexität | -0,12% |
| Effektive Duration | 3,16 |
| Rückzahlungsrendite | 7,43% |
| *Ausschüttungsrendite | 7,26% |

* Dieser Wert misst die historische Dividendenausschüttung je Aktie über zwölf Monate, geteilt durch den NIW.

Quelle: State Street Global Advisors Die aufgeführten Merkmale, Bestände, Länderallokationen und Sektoren entsprechen dem oben in diesem Factsheet angegebenen Datum und können sich ändern. Jegliche Bezugnahme auf ein bestimmtes Unternehmen oder Wertpapier stellt keine Empfehlung zum Kauf, Verkauf, Halten oder direkten Investieren in ein solches Unternehmen oder Wertpapier dar.

| Top-10-Positionen | Gewichtung (%) |
|--|----------------|
| CLARIV SCI HLD CORP 3.875 07/01/2028 | 1,02 |
| MAUSER PACKAGING SOLUT 7.875 04/15/2027 | 0,99 |
| CARNIVAL CORP 6 05/01/2029 | 0,96 |
| INTESA SANPAOLO SPA 4.198 06/01/2032 | 0,91 |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES 5.5 08/31/2026 | 0,90 |
| JETBLUE AIRWAYS/LOYALTY 9.875 09/20/2031 | 0,89 |
| GARRETT MOTION HLD/SARL 7.75 05/31/2032 | 0,87 |
| DIRECTV FIN LLC/COINC 5.875 08/15/2027 | 0,84 |
| BALL CORP 3.125 09/15/2031 | 0,81 |
| MERCER INTL INC 5.125 02/01/2029 | 0,79 |

| Bonität | Gewichtung (%) |
|-------------------|----------------|
| Aaa | 0,20 |
| Baa | 0,22 |
| Unterhalb der BAA | 99,39 |
| Nicht geratet | 0,20 |

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

| Sektorengewichtung | Gewichtung (%) |
|--------------------|----------------|
| Industrien | 86,96 |
| Finanzsektor | 11,98 |
| Versorger | 0,86 |
| Cash | 0,20 |

| Restlaufzeit (in Jahren) | Gewichtung (%) |
|--------------------------|----------------|
| 0 - 1 Jahr | 1,30 |
| 1 - 3 Jahre | 20,32 |
| 3 - 5 Jahre | 34,81 |
| 5 - 7 Jahre | 29,46 |
| 7 - 10 Jahre | 11,79 |
| 10 - 20 Jahre | 1,92 |
| > 20 Jahre | 0,40 |

Kapitalrisiko: Eine Anlage ist mit Risiken verbunden, einschließlich des Risikos eines Kapitalverlusts. Die bisherige Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung.

| Geografische Aufteilung | Gewichtung (%) |
|--------------------------------|-----------------------|
| USA | 82,40 |
| Kanada | 4,95 |
| Italien | 3,19 |
| Großbritannien | 2,51 |
| Deutschland | 1,43 |
| Australien | 1,08 |
| Frankreich | 1,02 |
| Spanien | 0,86 |
| Japan | 0,69 |
| MACAU | 0,56 |
| Österreich | 0,48 |
| Hong Kong | 0,32 |
| JERSEY CHANISLE | 0,19 |
| CAYMAN ISLANDS | 0,11 |
| Irland | 0,08 |
| Niederlande | 0,06 |
| Luxemburg | 0,05 |
| Europäische Union | 0,01 |

Kontaktieren Sie uns

Besuchen Sie unsere Webseite ssga.com/etfs oder kontaktieren Sie Ihren lokalen SPDR ETF Vertreter. Alternativ können Sie auch das SPDR ETF Sales & Support Team über spdrseurope@ssga.com erreichen.

Frankreich & Luxemburg

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

Italien

spdretf_italia@ssga.com
+39 0232066 140

Nordics

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

Schweiz

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

Deutschland

spdrsgermany@ssga.com
+49 69 66774 5016

Niederlande

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

Spanien

spdrseurope@ssga.com
+39 0232066 140

Großbritannien

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

ssga.com/etfs

RISIKOFAKTOREN

Der Fonds weist ein Risiko- und Ertragsprofil der Kategorie 4 auf, da seine Rendite in der Vergangenheit mittlere Anstiege und Rückgänge erlebt hat.

Im Folgenden sind wesentliche für den Fonds relevante Risiken aufgeführt, die durch die Risikokategorie nicht angemessen erfasst werden:

Konzentrationsrisiko Kreditrisiko

Durations-/Zinsänderungsrisiko Indexnachbildungsrisiko Liquiditätsrisiko und ETF-Liquiditätsrisiko Risiken im Zusammenhang mit Wertpapieren mit niedrigerem Rating Anteilsklassenrisiko

Bitte lesen Sie den Prospekt und die KIIDs für weitere Informationen zu den Risiken.

Glossar

Effektive Konvexität Eine Kennzahl der Krümmung im Verhältnis zwischen Anleihekursen und Anleiherenditen, die zeigt, wie sich die Duration einer Anleihe bei Zinsänderungen verändert.

Effektive Duration Eine Berechnung der Duration für Anleihen mit eingebetteten Optionen. Diese Durationskennzahl berücksichtigt die Tatsache, dass erwartete Cashflows bei Zinsänderungen schwanken. Die effektive Duration kann mittels der modifizierten Duration geschätzt werden, wenn eine Anleihe mit eingebetteten Optionen sich wie eine herkömmliche Anleihe ohne Optionen verhält.

Rückzahlungsrendite Die in Bezug auf eine Anleihe erwartete Gesamtrendite, wenn die Anleihe bis zur Fälligkeit gehalten wird. Die Rückzahlungsrendite wird als langfristige Anleiherendite erachtet, wird aber als jährlicher Satz angegeben. Anders ausgedrückt, es handelt sich um den internen Zinsfuß (IZF) einer Anlage in eine Anleihe, wenn der Anleger die Anleihe bis zur Fälligkeit hält und wenn alle Zahlungen planmäßig erfolgen.

Ausschüttungsrendite Die jährlichen Dividenden je Anteil des Fonds, dividiert durch den Anteilspreis des Fonds.

Delta Eine Kennzahl der Aktiensensitivität, die das Verhältnis zwischen einer prozentualen Veränderung im Aktienkurs und die entsprechende prozentuale Veränderung im Wandelanleihenkurs darstellt, sie wird auch als Preiselastizität bezeichnet.

TER Bei der Total Expense Ratio handelt es sich um eine Gebühr, die dem Fonds als Prozentsatz des Nettoinventarwerts zur Deckung der mit dem Betrieb und dem Management des Vermögensportfolios

verbundenen Kosten erhoben wird.

Nur für professionelle Kunden / qualifizierte Anleger. Nicht für den öffentlichen Vertrieb.

Börsengehandelte Indexfonds (ETFs) werden wie Aktien gehandelt, unterliegen Anlagerisiken und ihr Marktwert schwankt. Der Wert der Anlage kann sowohl fallen als auch steigen, und die Rendite der Anlage ist deshalb veränderlich. Wechselkursänderungen können sich nachteilig auf Wert, Kurs oder Ertrag einer Anlage auswirken. Des Weiteren gibt es keine Garantie dafür, dass ein ETF sein Anlageziel erreichen wird.

Marketingmitteilung

SPDR ETFs sind möglicherweise nicht für Sie erhältlich oder geeignet. Die hier erteilten Informationen stellen keine Anlageberatung gemäß Definition nach der Richtlinie über Märkte für Finanzinstrumente (2014/65/EG) dar und sollten nicht als Grundlage für eine Anlageentscheidung herangezogen werden. Sie sind auch nicht als Aufforderung zum Kauf oder als Angebot zum Verkauf einer Anlage zu verstehen. Die bestimmten Anlageziele, Strategien, der steuerliche Status, die Risikobereitschaft bzw. der Anlagehorizont eines Anlegers oder potenziellen Anlegers sind darin nicht berücksichtigt.

Die steuerliche Behandlung hängt von den individuellen Umständen jedes Kunden ab und kann sich in Zukunft ändern.

Falls Sie Anlageberatung benötigen, sollten Sie sich an Ihren Steuer-, Finanz- oder sonstigen Fachberater wenden.

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-spd-investors-rights-summary.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 lösen.

Alle Dokumente in Bezug auf die Fonds sind kostenlos von den Geschäftsstellen des lokalen Vertreters/Vermittlers zu beziehen, stehen im Internet unter www.ssga.com zur Verfügung oder sind von State Street Custodial Services (Ireland) Limited, 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, Irland, erhältlich. SPDR ETFs ist die Plattform von State Street Global Advisors für börsengehandelte Indexfonds ("ETF") und enthält Fonds, die von der Central Bank of Ireland als offene OGAW-

Investmentgesellschaften genehmigt wurden. Für US-Anleger sind die Fonds nicht erhältlich. SSGA SPDR ETFs Europe I plc und SPDR ETFs Europe II plc („die Gesellschaft“) emittieren SPDR ETFs und bilden eine offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital und getrennter Haftung zwischen ihren Teilfonds. Die Gesellschaft ist als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) nach irischem Recht organisiert und als OGAW von der Central Bank of Ireland zugelassen.

Zusätzliche wichtige Informationen: - Für Großbritannien wurde dieses Dokument von State Street Global Advisors Limited („SSGA“) herausgegeben. Zugelassen und reguliert von der Financial Conduct Authority, registriert unter der Nr. 2509928. USt. Nr. 5776591 81. Eingetragener Sitz: 20 Churchill Place, Canary Wharf, London, E14 5HJ Telefon: 020 3395 6000, Fax: 020 3395 6350, Internet: www.ssga.com. **Für die EU** wurde dieses Dokument von State Street Global Advisors Europe Limited („SSGA“), reguliert von der Central Bank of Ireland, herausgegeben. Adresse des eingetragenen Sitzes: 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2. Registrierungsnummer 49934. Tel.: +353 (0)1 776 3000. Fax: +353 (0)1 776 3300. Internet: www.ssga.com.

Lokale Vertreter/Zahlstellen von SPDR ETFs:

Frankreich: State Street Bank International GmbH Paris Branch, Cœur Défense -Tour A, 100, Esplanade du Général de Gaulle, 92931 Paris La Defense Cedex; **Schweiz:** State Street Bank GmbH Munich, Niederlassung Zürich, Beethovenstrasse 19, 8027 Zürich, und die Hauptvertriebsstelle in der Schweiz, State Street Global Advisors AG, Beethovenstrasse 19, 8027 Zürich; **Deutschland:** State Street Global Advisors Europe Limited, Briener Strasse 59, D-80333 München; **Spanien:** Cecabank, S.A. Alcalá 27, 28014 Madrid (Spanien); **Dänemark:** Nordea Bank Denmark A/S, Issuer Services, Securities Services Hermes Hus, Helgeshøj Allé 33 Postbox 850, DK-0900 Kopenhagen C; **Österreich:** Erste Bank, Graben 21, 1010 Wien; **Schweden:** SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB, Global Transaction Services ST MH1, SE-106 40 Stockholm, Schweden.

„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. Der S&P 500® Index ist ein Produkt von S&P Dow Jones Indices LLC oder seinen verbundenen Unternehmen („S&P DJI“), für dessen Verwendung State Street Global Advisors eine Lizenz gewährt wurde. S&P®, SPDR®, S&P 500®, US 500 und die 500 sind eingetragene Marken von Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“); Dow Jones® ist eine eingetragene Marke von Dow Jones Trademark Holdings LLC („Dow Jones“) und wurde für die Verwendung durch S&P Dow Jones Indices lizenziert; und für die Verwendung dieser Marken wurde S&P DJI eine Lizenz und State Street Global Advisors eine Unterlizenz für bestimmte Zwecke gewährt. Der Fonds wird von S&P DJI, Dow Jones, S&P und ihren jeweiligen verbundenen Unternehmen weder gesponsort oder anderweitig unterstützt noch verkauft oder beworben; die genannten Parteien sichern in keiner Weise die Ratsamkeit der Investition in dieses Produkt/diese Produkte zu und haften nicht für Fehler, Auslassungen oder Unterbrechungen in der Berechnung und Verbreitung dieser Indizes.

Die hierin erwähnten Marken und Dienstleistungsmarken sind Eigentum ihrer jeweiligen Inhaber. Unabhängige Datendienstleister 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.

Der Empfänger ist nur berechtigt, die Indexdaten in der Form anzusehen oder zu erhalten, in der sie vorgelegt werden. Der Empfänger nimmt zur Kenntnis und erklärt sich damit einverstanden, dass die Nutzung der Indexdaten auf eigenes Risiko erfolgt. Der Empfänger nimmt zur Kenntnis und erklärt sich damit einverstanden, dass die Indexdaten so, wie sie sind, bereitgestellt werden und dass weder Morningstar UK Limited (Morningstar) noch ihre Inhalte-Anbieter die Richtigkeit, Vollständigkeit, Nichtverletzung, Echtheit, Aktualität oder sonstige Merkmale der Indexdaten garantieren. Ferner nimmt der Empfänger zur Kenntnis und erklärt sich damit einverstanden, dass die Indexdaten Ihnen als Anleger in Finanzprodukten ausschließlich gemäß regulatorischen Vorschriften und nur zu Informationszwecken bereitgestellt werden. Die Indexdaten dürfen von Ihnen nicht zu kommerziellen Zwecken oder zu Handels- oder anderen Zwecken anstelle eines Abonnements dieser Indexdaten von Morningstar verwendet werden. Dieses Werk darf ohne ausdrückliche schriftliche Einwilligung von SSGA weder ganz noch teilweise vervielfältigt, kopiert oder übertragen und sein Inhalt gegenüber Dritten nicht offengelegt 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.

Die angezeigten Daten innerhalb des Factsheet für die ESG Sektionen sind die aktuellsten zur Verfügung stehenden und haben einen 1-Monats Verzug gegenüber dem Berichtsdatum.

Quelle: State Street Global Advisors. Positionen mit Stand zum 31 Okt 2024, R-Faktor-Daten mit Stand zum 30 Sep 2024.

R-Factor-Profil des Fonds

| | |
|-----------------|--------|
| Nicht verfügbar | 3,84% |
| Nachzügler | 0,57% |
| Underperformer | 2,05% |
| Durchschnitt | 19,54% |
| Outperformer | 41,98% |
| Spitzenreiter | 32,01% |

Quelle: State Street Global Advisors. Positionen mit Stand zum 31 Okt 2024, R-Faktor-Daten mit Stand zum 30 Sep 2024.

R-Factor

| R-Factor-Zusammenfassung | Fonds |
|--------------------------|-------|
| R-Factor | 64 |

Quelle: State Street Global Advisors. Positionen mit Stand zum 31 Okt 2024, R-Faktor-Daten mit Stand zum 30 Sep 2024.

| Fondsberichterstattung | Anzahl | Prozentualer Anteil an den gesamten Wertpapieren (%) | Prozentualer Anteil am gesamten Marktwert (%) |
|---------------------------------------|--------|--|---|
| R-Factor-Wertpapierberichterstattung | 625 | 92,18 | 96,16 |
| Gesamtanzahl der Wertpapiere im Fonds | 678 | | |

Quelle: State Street Global Advisors. Positionen mit Stand zum 31 Okt 2024, R-Faktor-Daten mit Stand zum 30 Sep 2024.

| Top-10-Positionen | Fondsgewichtung (%) | R-Factor-Rating |
|--|---------------------|-----------------|
| OneMain Finance Corp | 2,71 | 78 |
| Royal Caribbean Cruises Ltd | 2,30 | 63 |
| Carnival Corp | 2,14 | 66 |
| CommScope LLC | 2,11 | 69 |
| Intesa Sanpaolo SpA | 2,11 | 97 |
| Bombardier Inc | 2,00 | 61 |
| CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp | 1,89 | 55 |
| Vodafone Group PLC | 1,65 | 75 |
| Ball Corp | 1,65 | 81 |
| Mauser Packaging Solutions Holding Co | 1,64 | 66 |

Höchste 5 R-Factor-Ratings

| | | |
|----------------------------|------|----|
| Intesa Sanpaolo SpA | 2,11 | 97 |
| Interface Inc | 0,25 | 83 |
| Vallourec SACA | 0,64 | 82 |
| Alcoa Nederland Holding BV | 0,18 | 82 |
| Crown Americas LLC | 0,53 | 81 |

Niedrigste 5 R-Factor-Ratings

| | | |
|---|------|----|
| Odeon Finco PLC | 0,05 | 18 |
| Carvana Co | 0,06 | 25 |
| LGI Homes Inc | 0,05 | 26 |
| Uniti Group LP / Uniti Group Finance 2019 Inc / CSL Capital LLC | 0,08 | 27 |
| Ithaca Energy North Sea PLC | 0,08 | 28 |

Quelle: State Street Global Advisors. Positionen mit Stand zum 31 Okt 2024, R-Faktor-Daten mit Stand zum 30 Sep 2024.

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

| Klima-Kennzahlen | | Fonds |
|--|--|------------|
| Gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität (WACI) | Gewichtete durchschnittliche CO2-Emissionen pro 1 Mio. USD Umsatz | 218,47 |
| WACI-Deckung | Gewichteter Marktwert (%) | 92,37% |
| | Anzahl der Wertpapiere (%) | 89,68% |
| Reserven fossiler Brennstoffe | Gewichteter Durchschnitt des eingebetteten CO2 (in Millionen Tonnen) | 5,14 |
| Braune Einnahmen | % vom Umsatz | 5,18% |
| Anpassungs-Score (0-1) | Gewichtete durchschnittliche Punktzahl von 0 (niedrig) bis 1 (hoch) | 0,59 |
| Green Bonds und klimagerechte Anleihen | Gewichteter Marktwert (%) | 1,01% |
| Green Bonds | Gewichteter Marktwert (%) | 1,01% |
| Klimagerechte Anleihen | Gewichteter Marktwert (%) | 0,00% |
| TCFD – Kohlenstoff-Kennzahlen | | Fonds |
| TCFD – Gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität (WACI) | | 178,16 |
| TCFD – Gesamte Kohlenstoffemissionen** | | 51.908,83* |
| TCFD – CO2-Bilanz | | 127,31 |
| TCFD – Kohlenstoffintensität | | 207,82 |

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.

ESG Risk Rating Score

| | Fonds |
|---|-------|
| ESG Risk Rating Score | 20,01 |
| Deckung (Marktwert in Prozent) | 58,64 |
| Deckung (Anzahl der Wertpapiere in Prozent) | 53,83 |

Quelle: Sustainalytics/SSGA zum Stand vom 30 Sep 2024.

Die oben dargestellten Nachhaltigkeitsinformationen sollen den Anlegern Transparenz über die Nachhaltigkeitsmerkmale des Fonds bieten. Die Darstellung dieser Informationen sollte weder als Darstellung des aktuellen oder zukünftigen Anlageziels des Fonds verstanden werden, noch sollte sie als Indikator für die aktuelle oder zukünftige Anlageentscheidung des Fondsmanagers angesehen werden. Für Informationen zur SFDR-Kategorie des Fonds werden Anleger gebeten, den [Prospekt/KIID] des Fonds zu lesen.

Anleger sollten eine Anlage in den Fonds nicht ausschließlich auf der Grundlage der oben genannten Informationen bewerten, sondern vielmehr andere Faktoren berücksichtigen, darunter das allgemeine Anlageziel und das Risikoprofil des Fonds. Anlegern wird empfohlen, den [https://www.ssga.com/fund-finder?tab=documents] des Fonds zu lesen, um weitere Informationen über den Fonds zu erhalten.

Die oben genannten Informationen Dritter stammen aus Quellen, die zum angegebenen Datum als zuverlässig galten, ihre Richtigkeit wird jedoch nicht garantiert. SSGA übernimmt keine Haftung für Investitionsentscheidungen, die auf diesen Informationen basieren, und man sollte sich nicht auf sie als solche verlassen. Es gibt keine Zusage oder Garantie hinsichtlich der aktuellen Richtigkeit, Zuverlässigkeit oder Vollständigkeit dieser Informationen.

R-Factor™ R-Factor™ ist ein ESG-Scoring-System, das allgemein anerkannte transparente wesentlichspezifische Rahmenwerke nutzt, die von einer großen Zahl von Unternehmen und Anlegern unterstützt werden, um einen einzigartigen ESG-Score für börsennotierte Unternehmen zu ermitteln. Der Score basiert auf ESG-Daten von vier verschiedenen Anbietern (Sustainalytics, ISS-Oekom, Vigeo-EIRIS und ISS-Governance), 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.

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.

Abweichungen zwischen der Anzahl der Positionen in der R-Factor™-Übersicht und der Anzahl der Positionen im regulären Reporting-Paket können auftreten, denn die R-Factor™-Übersicht zählt die Anzahl der Emittenten und nicht die Anzahl der Positionen im Portfolio.

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 wahrscheinlichen 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 Publikationen 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 Zusage 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.

© 2024 State Street Corporation. Alle Rechte vorbehalten. Fälligkeit: 31/10/2025