

SPDR® STOXX Europe 600 SRI UCITS ETF (Acc)

Foglio informativo

30 settembre 2024

Environmental, Social & Governance

★★★★★

Morningstar Rating™

31 agosto 2024



Obiettivo del Fondo

L'obiettivo di investimento del Fondo è replicare la performance delle azioni europee.

Descrizione dell'indice

L'indice STOXX® Europe 600 SRI replica la performance dell'indice STOXX® Europe 600 dopo l'applicazione di vari criteri di esclusione basati sull'intensità delle emissioni, la compliance con determinati criteri, il coinvolgimento in attività controverse e la performance ESG. Il 10% delle società che registrano l'intensità di emissioni più elevata non vengono ritenute idonee alla selezione. Le società coinvolte in alcune attività controverse vengono escluse. I titoli rimanenti vengono classificati in ordine decrescente secondo i rispettivi punteggi ESG all'interno di ciascuno degli 11 settori ICB. L'indice STOXX® Europe 600 SRI seleziona i titoli con il miglior rating in ciascuno dei settori ICB fino a quando il numero di titoli scelti non è ridotto a un terzo di quelli presenti nell'indice sottostante.

Regime Fiscale

Di norma, SSGA punta a soddisfare tutti i requisiti di informativa fiscale applicabili per tutti gli ETF SPDR nei paesi di seguito elencati. Le domande vengono presentate nel corso dell'intero anno a seconda dei termini previsti dalle singole autorità tributarie locali: Regno Unito, Germania, Austria, Svizzera.

Paesi di registrazione

Svizzera, Svezia, Spagna, Regno Unito, Paesi Bassi, Norvegia, Lussemburgo, Italia, Irlanda, Germania, Francia, Finlandia, Danimarca, Austria

Informazioni sul Fondo

ISIN	IE00BK5H8015
Benchmark	STOXX Europe 600 SRI Index
Codice Indice	SXXRSRI
Tipo Indice	Rendimento Totale Netto
Numero Di Componenti	200

Dati Principali

Data di lancio	30-Sep-2019
Valuta della classe di azioni	EUR
Fondo — Valuta di Base	EUR
TER	0,12%
Politica dei Dividendi	Accumulazione
Metodologia di Replica	Replicato
Armonizzazione UCITS	Sì
Classificazione SFDR del fondo	Articolo 8 SFDR
Domicilio	Irlanda
Società di gestione	State Street Global Advisors Europe Limited
Società di gestione delegata	State Street Global Advisors Limited
Società Emittente	SSGA SPDR ETFs Europe II plc
Asset della Classe di Azioni (milioni)	€314,53
Asset Totali del Fondo (milioni)	€314,53
Idoneo ISA	Sì
Idoneo SIPP	Sì
Idoneo PEA	No

Prima del 1 dicembre 2021 il Fondo era noto come SPDR® STOXX Europe 600 ESG Screened UCITS ETF (Acc) e riproduceva l'indice STOXX Europe 600 ESG-X Index. Variazione dell'indice: L'indice riflette i rendimenti collegati alla performance del STOXX Europe 600 SRI Index e del STOXX Europe 600 ESG-X Index. I rendimenti dell'indice riflettono il STOXX Europe 600 ESG-X Index dal lancio del fondo fino al November 30, 2021 e il STOXX Europe 600 SRI Index dal November 30, 2021 ad oggi. Si prega di notare che a causa della chiusura di tutti i comparti SSGA SPDR ETF Europe I e II di venerdì 29 marzo 2024, i prezzi dei fondi rifletteranno il NAV di giovedì 28 marzo, il che significa che le performance mensili del fondo potrebbero differire rispetto al benchmark.

Quotazioni

Borsa	Codice Borsa	Valuta di Negoziazione	Codice iNAV	Codice Bloomberg	Codice Reuters	Codice SEDOL
Deutsche Börse*	ZPDX	EUR	INZPDX	ZPDX GY	ZPDX.DE	BK9HD91
Borsa Italiana	600X	EUR	INZPDX	600X IM	600X.MI	BK9HDB3
Euronext Amsterdam	600X	EUR	INZPDX	600X NA	600X.AS	BK5H801
SIX Swiss Exchange	600X	EUR		600X SE	600X.S	BK9HDC4

*Indicare la borsa principale

Performance					
	Indice	Fondo Lorde	Differenza	Fondo Nette	Differenza
Performance Annualizzata (%)					
1 Anno	23,84	24,28	0,44	24,13	0,29
3 Anni	9,06	9,39	0,33	9,26	0,20
5 Anni	9,45	9,75	0,30	9,62	0,17
10 Anni	-	-	-	-	-
Dal Lancio	9,45	9,75	0,30	9,62	0,17
Performance Cumulativa (%)					
1 Mese	-0,77	-0,77	0,00	-0,78	-0,01
3 Mesi	1,31	1,31	0,00	1,28	-0,03
1 Anno	23,84	24,28	0,44	24,13	0,29
2 Anni	48,16	49,15	0,99	48,79	0,63
3 Anni	29,74	30,92	1,18	30,45	0,71
5 Anni	57,11	59,28	2,17	58,33	1,22
10 Anni	-	-	-	-	-
Dal Lancio	57,11	59,28	2,17	58,33	1,22
Performance (Anno Solare) (%)					
2024	14,70	15,07	0,37	14,97	0,27
2023	18,90	19,30	0,40	19,16	0,25
2022	-11,81	-11,58	0,22	-11,69	0,12
2021	25,43	25,90	0,47	25,75	0,32
2020	-1,86	-1,81	0,05	-1,93	-0,07
2019	6,11	6,15	0,04	6,11	0,01

	(%) Fondo
Deviazione standard (3 Anni)	13,41
Tracking Error Annualizzato (3 Anni)	0,18

La performance storica non offre garanzia di rendimenti futuri. I dati di performance qui riportati non tengono conto delle commissioni e dei costi di emissione o rimborso, o acquisto e vendita, delle quote. Se la performance è calcolata sulla base di valori patrimoniali netti non denominati nella valuta di base del fondo, il suo valore potrebbe aumentare o diminuire a seguito della fluttuazione dei tassi di cambio.

Qualora il Fondo sia chiuso nel rispetto del calendario del Valore Patrimoniale Netto (VPN) ufficiale ma, ciononostante, sia possibile determinare una parte significativa dei prezzi dei titoli sottostanti, si calcola un VPN tecnico. Pertanto, i risultati ottenuti nel passato qui riportati sono stati calcolati utilizzando un VPN tecnico, ove necessario, oltre al VPN ufficiale del Fondo in ciascun altro giorno lavorativo per il periodo in esame.

Se la data di lancio del Fondo in questione o del Fondo legato alla performance storica (la prima delle due in ordine di tempo) cade in detto periodo, i rendimenti della performance nell'anno solare del lancio saranno parziali.

Caratteristiche	
Numero di Titoli	200
*Distribution Yield	-
Rapporto prezzo/utigli - FY1	15,68
Price/Book medio	2,41
Media capitalizzazione di mercato (in Milioni)	€107.369,29
Dividend Yield dell'Indice	2,91%

* Misura i dividendi distribuiti negli ultimi 12 mesi per azione divisi per il NAV.

Fonte: SSGA Le caratteristiche, le posizioni, le scomposizioni geografiche e settoriali indicati sono aggiornati alla data indicata nella parte superiore di questo factsheet e sono soggetti a modifiche. Qualsiasi riferimento a una società o ad un titolo specifico non costituisce una raccomandazione ad acquistare, vendere, detenere o investire direttamente in tale società o titolo.

Le 10 Principali Posizioni	Peso (%)
NOVO NORDISK A/S-B	7,03
ASML HOLDING NV	6,19
SAP SE	4,33
NOVARTIS AG-REG	4,31
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	4,19
UNILEVER PLC	3,05
SIEMENS AG-REG	2,83
SANOFI	2,46
ALLIANZ SE-REG	2,40
L OREAL	2,02

Ripartizione Per Settore	Peso (%)
Sanità	24,10
Finanziari	21,21
Industria	15,37
Tecnologia	13,26
Beni di consumo ciclici	10,06
Beni di consumo non ciclici	6,57
Telecomunicazioni	4,19
Materiali di base	2,41
Immobili	1,68
Utilities	0,73
Energia	0,42

A partire dal 22 marzo 2021, l'index provider è passato al nuovo framework ICB. Le modifiche includevano: la ridenominazione del settore "Oil & Gas" in "Energia", la separazione del settore "Immobiliare" da quello "Finanziario" e la creazione di un undicesimo settore denominato "Immobiliare" e la riclassificazione dei "Beni di consumo" e "Beni di Servizio" come "Beni di prima necessità" e "Beni di consumo voluttuari".

L'Industry Classification Benchmark (ICB) è una tassonomia di classificazione dei settori utilizzata da FTSE International e STOXX.

Rischio di capitale: L'investimento implica alcuni rischi, tra i quali il rischio di perdita di capitale. La performance passata non è un indicatore affidabile di quella futura.

Ripartizione Per Paese	Peso (%)
Germania	18,96
Svizzera	17,82
Francia	15,63
Regno Unito	13,02
Danimarca	9,39
Paesi Bassi	8,61
Italia	4,61
Spagna	3,89
Svezia	3,11
Finlandia	1,96
Belgio	0,97
Norvegia	0,78
Irlanda	0,61
Austria	0,41
Portogallo	0,09
Altri	0,12

Contattaci

Visita il nostro sito all'indirizzo ssga.com/etfs o contatta un rappresentante locale del team SPDR. In alternativa, contatta il nostro team di supporto SPDR ETFs all'indirizzo spdrseurope@ssga.com.

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

Italia
spdretf_italia@ssga.com
 +39 0232066 140

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

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

Germania
spdrsgermany@ssga.com
 +49 69 66774 5016

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

Spagna
spdrseurope@ssga.com
 +39 0232066 140

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

ssga.com/etfs

Fattori di Rischio

Il Fondo ha un profilo di rischio e rendimento di categoria 6 poiché storicamente la sua performance ha registrato aumenti e cali di media entità.

Di seguito sono riportati i principali rischi legati all'investimento nel Fondo che non sono adeguatamente evidenziati dalla categoria di rischio.

Rischio di concentrazione

Rischio di replica dell'Indice

Rischio di liquidità e Rischio di liquidità ETF

Rischio di selezione

SFDR - Rischio di classificazione dei fondi

Si prega di leggere il Prospetto e i KIID per ulteriori informazioni sui rischi.

Glossario

Rapporto prezzo/utigli AF1 Il prezzo medio di ciascun titolo sottostante diviso per la stima media dell'utile per azione (EPS) del titolo nel successivo esercizio finanziario non dichiarato, alla data di rendicontazione.

Media del prezzo/valore contabile La media del prezzo di ciascun titolo sottostante divisa per il valore contabile per azione del titolo, alla data di rendicontazione.

Rapporto dividendo/prezzo dell'indice La media dei dividendi annui per azione (DPS) di ciascun titolo sottostante nell'indice alla data di rendicontazione divisa per il prezzo del titolo alla data di rendicontazione.

TER Il Total Expense Ratio è una commissione addebitata al fondo, come percentuale del Valore patrimoniale netto, a copertura dei costi associati al funzionamento e alla gestione del portafoglio di attivi.

Per uso esclusivo di clienti professionali / investitori qualificati. Non destinato alla distribuzione al pubblico.

Gli ETF (Exchange Traded Fund) vengono negoziati come i titoli azionari, comportano un rischio d'investimento e il loro valore di mercato è soggetto a fluttuazioni. Il valore degli investimenti può sia aumentare sia diminuire, pertanto il rendimento degli investimenti sarà

variabile. Le oscillazioni dei tassi di cambio possono causare effetti negativi sul valore, sulla quotazione o sul reddito di un investimento. Inoltre non viene fornita alcuna garanzia che l'ETF raggiunga l'obiettivo d'investimento.

Comunicazione commerciale

Gli ETF SPDR potrebbero non essere disponibili o adeguati all'investitore. Le informazioni fornite non costituiscono una consulenza agli investimenti così come questa espressione è definita nella Direttiva MiFID (2014/65/UE) e l'investitore non dovrà farvi affidamento. Non devono intendersi come sollecitazione all'acquisto o offerta alla vendita di qualsiasi investimento. Non prendono in considerazione particolari orizzonti o obiettivi d'investimento, status fiscali, strategie o propensioni al rischio di qualsiasi investitore attuale o potenziale. Qualora si renda necessaria una consulenza agli investimenti, suggeriamo di consultare il proprio consulente fiscale e finanziario o altro professionista di fiducia.

Il presente documento non costituisce un'offerta o un invito all'acquisto di azioni di SPDR ETFs Europe I plc e SPDR ETFs Europe II plc.

Prima di prendere qualsiasi decisione di investimento, si prega di fare riferimento all'ultimo Documento contenente le informazioni chiave (KID) o Documento contenente le informazioni chiave per l'investitore (KIID) e al Prospetto informativo del Fondo. L'ultima versione in inglese del prospetto informativo e del KID/ KIID è disponibile sul sito www.ssga.com. Un riepilogo dei diritti degli investitori è disponibile all'indirizzo: <https://www.ssga.com/library-content/products/fund-docs/summary-of-investor-rights/ssga-spdr-investors-rights-summary.pdf> Si noti che la Società di gestione può decidere di rescindere gli accordi presi per la commercializzazione e procedere con la denotifica in conformità all'articolo 93a della Direttiva 2009/65/CE.

Tutti i documenti relativi al fondo sono disponibili gratuitamente presso la sede del Rappresentante/Agente locale, visitando il sito www.ssga.com o contattando State Street Custodial Services (Ireland) Limited, 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, Irlanda. SPDR ETFs è la piattaforma di exchange traded fund ("ETF") di State Street Global Advisors ed include fondi autorizzati dalle Banca centrale

irlandese come fondi aperti d'investimento UCITS.

I fondi non sono disponibili per gli investitori statunitensi.

SSGA SPDR ETFs Europe I plc e SPDR ETFs Europe II plc (la "Società") emettono ETF di SPDR, e sono strutturate come società d'investimento di tipo aperto a capitale variabile e con separazione delle passività fra i comparti. La Società è organizzata come Organismo di investimento collettivo in valori mobiliari (OICVM) di diritto irlandese e autorizzata come OICVM dalla Banca centrale irlandese.

Informazioni aggiuntive importanti:

Per il Regno Unito, il presente documento è stato pubblicato da State Street Global Advisors Limited ("SSGA"). Autorizzata e disciplinata dalla Financial Conduct Authority (autorità di vigilanza britannica) ed è iscritta nel registro delle imprese con il numero 2509928. Partita IVA 5776591 81. Sede legale: 20 Churchill Place, Canary Wharf, London, E14 5HJ Telefono: 020 3395 6000 - Fax: 020 3395 6350 - Sito web: www.ssga.com.

Per l'UE, il presente documento è stato pubblicato da State Street Global Advisors Europe ("SSGA"), regolamentata dalla Banca Centrale d'Irlanda. Indirizzo della sede legale: 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2. Numero di iscrizione 49934. T: +353 (0)1 776 3000. Fax: +353 (0)1 776 3300. Web: www.ssga.com.

Rappresentante locale/Agenti di pagamento di SPDR ETFs:

Francia: State Street Bank International GmbH Paris Branch, Cœur Défense - Tour A, 100, Esplanade du Général de Gaulle, 92931 Paris La Defense Cedex; **Svizzera:** State Street Bank GmbH Munich, Zurich Branch, Beethovenstrasse 19, 8027 Zurich e il distributore principale in Svizzera, State Street Global Advisors AG, Beethovenstrasse 19, 8027 Zurich; **Germania:** State Street Global Advisors Europe Limited, Brienner Strasse 59, D-80333 Munich; **Spagna:** Cecabank, S.A. Alcalá 27, 28014 Madrid (Spain); **Danimarca:** Nordea Bank Denmark A/S, Issuer Services, Securities Services Hermes Hus, Helgeshøj Allé 33 Postbox 850 DK-0900 Copenhagen C; **Austria:** Erste Bank, Graben 21, 1010 Wien, Austria;

Svezia: SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB, Global Transaction Services ST MH1, SE-106 40 Stockholm, Svezia.

L'indice S&P 500® è un prodotto di S&P Dow Jones Indices LLC o delle sue affiliate ("S&P DJI") ed è stato concesso in licenza d'uso a

State Street Global Advisors. S&P®, SPDR®, S&P 500®, US 500 e 500 sono marchi registrati di Standard & Poor's Financial Services LLC ("S&P"); Dow Jones® è un marchio registrato di Dow Jones Trademark Holdings LLC ("Dow Jones") ed è stato concesso in licenza d'uso da S&P Dow Jones Indices; questi marchi sono stati concessi in licenza d'uso da S&P DJI e concessi in sub-licenza per fini specifici da State Street Global Advisors. Il fondo non è sponsorizzato, sostenuto, venduto o promosso da S&P DJI, Dow Jones, S&P, le rispettive affiliate e nessuna di tali parti rilascia alcuna dichiarazione in merito all'opportunità di investire in tali prodotti, né ha alcuna responsabilità per eventuali errori, omissioni o interruzioni di tali indici.

I marchi registrati e i marchi di servizio qui riferiti appartengono ai rispettivi proprietari. I fornitori di dati di terze parti non rilasciano garanzie o dichiarazioni di alcun tipo in merito all'accuratezza, alla completezza o alla puntualità dei dati e non hanno responsabilità per danni di alcun tipo relativi all'utilizzo di tali dati.

Il destinatario è autorizzato a visualizzare o ricevere i Dati dell'Indice esclusivamente nella forma in cui vengono presentati. Il destinatario comprende, riconosce e accetta che l'uso dei Dati dell'Indice è a suo rischio esclusivo. Il destinatario comprende, riconosce e accetta che i Dati dell'Indice vengono forniti "così come sono" e che né Morningstar UK Limited (Morningstar) né i suoi fornitori di contenuti garantiscono l'accuratezza, la completezza, la non violazione, l'originalità, la tempestività o qualsiasi altra caratteristica dei Dati dell'Indice. Il destinatario comprende, riconosce e accetta altresì che i Dati dell'Indice gli vengono forniti in qualità di investitore in prodotti finanziari esclusivamente in conformità ai requisiti normativi e a scopo puramente informativo. I Dati dell'Indice non possono essere utilizzati dal destinatario per scopi commerciali e non possono essere utilizzati per il trading o per altri scopi che sostituiscano la sottoscrizione di tali Dati dell'Indice presso Morningstar. È vietato riprodurre, copiare o trasmettere la totalità o parte del presente documento, né il suo contenuto può essere divulgato a terzi senza l'esplicita approvazione scritta di SSGA.

Sintesi del Fattore R™

Il Fattore R™ è ottenuto tramite una metodologia di assegnazione di un punteggio che sfrutta la Materiality Map, uno strumento del Sustainability Accounting Standards Board (SASB), i codici di corporate governance e le informazioni di quattro dei migliori fornitori di dati ESG. Il Fattore R sostiene lo sviluppo dei mercati dei capitali sostenibili, offrendo agli investitori la possibilità di investire in soluzioni che integrano dati ESG determinanti in ambito finanziario, incentivando al contempo le società affinché migliorino le pratiche e la comunicazione ESG nei settori rilevanti.

I dati inclusi nelle sezioni ESG di questa Factsheet sono gli ultimi disponibili e sono aggiornati al mese precedente rispetto alla data di riferimento del documento.

Fonte: Factset/SSGA. Posizioni aggiornate al 30 set 2024, dati R-Factor al 31 ago 2024.

Profilo del Fattore R del Fondo

Non disponibile	0,00%
Fanalino di coda	0,00%
Sottoperformance	0,00%
Performance intermedia	1,29%
Sovraperformance	11,53%
Leader	87,18%

Fonte: Factset/SSGA al 31 ago 2024.

Fattore R

Sintesi del Fattore R	Fondo
Fattore R	79

Fonte: Factset/SSGA al 31 ago 2024.

Copertura del Fondo	Conteggio	Percentuale dei titoli totali (%)	Percentuale del valore di mercato totale (%)
Copertura titoli Fattore R	200	100,00	100,00
Numero totale di titoli nel Fondo	200		

Fonte: Factset/SSGA al 31 ago 2024.

Prime 10 posizioni	Ponderazione del Fondo (%)	Valutazione del Fattore R
Novo Nordisk A/S Class B	7,03	77
ASML Holding NV	6,19	84
SAP SE	4,33	87
Novartis AG	4,31	90
Roche Holding Ltd Dividend Right Cert.	4,19	77
Unilever PLC	3,05	77
Siemens Aktiengesellschaft	2,83	81
Sanofi	2,46	90
Allianz SE	2,40	88
L'Oreal S.A.	2,02	90

Prime 5 valutazioni del Fattore R		
Danone SA	0,87	100
Aena SME SA	0,30	99
Teleperformance SE	0,12	97
Intesa Sanpaolo S.p.A.	1,29	97
CaixaBank SA	0,41	95

Ultime 5 valutazioni del Fattore R		
Addtech AB Class B	0,15	49
Electrolux AB Class B	0,04	50
Kuehne & Nagel International AG	0,28	51
Swiss Life Holding AG	0,45	52
Vistry Group PLC	0,10	53

Fonte: Factset/SSGA al 31 ago 2024.

La sintesi del Fattore R rispecchia solo alcune caratteristiche ESG e non riflette la performance del fondo. Consultare la sezione sulle Informazioni importanti per maggiori dettagli e definizioni dei Parametri ESG presentati.

Indicatori sul Clima

Indicatori sul Clima	Fondo
Intensità di carbonio (diretta + indiretta)	90,32
Intensità di carbonio media ponderata (diretta + indiretta)	55,70
Totale emissioni delle riserve di carbonio	0,00
Emissioni di carbonio di Scopo 1+2	612501,87
Emissioni totali di carbonio (TCFD)**	3.376,86*
Carbon Footprint (TCFD)	9,65
Intensità di Carbonio (TCFD)	25,91
Intensità di Carbonio Media Ponderata (TCFD)	20,53
Brown Revenue %	0,06
Green Revenue %	2,15

Consulta il "Glossario" per note dettagliate di calcolo come il trattamento dei dati mancanti, il ritardo dei dati e le esclusioni. Fonte: State Street Global Advisors, S&P Trucost, FactSet, Task Force on Climate-related Financial Disclosures (TCFD). I risultati sono stime basate su ipotesi e analisi effettuate da State Street Global Advisors. Non intendono rappresentare i risultati effettivi di alcuna offerta. I risultati effettivi potrebbero differire.* Il parametro TCFD Total Carbon Emission assegna le emissioni agli investitori in base a un approccio di proprietà azionaria. Nel caso dei fondi comuni, i risultati rappresentano la responsabilità ambientale dell'intero patrimonio gestito del fondo. Per la responsabilità del singolo detentore di quote, è possibile calcolare una responsabilità ripartita in base alla percentuale di partecipazione individuale. ** Il parametro non viene utilizzato per confrontare portafogli e benchmark perché i dati non sono normalizzati.

Profilo di stewardship T2 2024

Numero di assemblee con voto	171
Numero di paesi	16
Proposte della direzione	3.408
Voti favorevoli	94,48%
Voti contrari	5,52%
Proposte degli azionisti	60
Con la direzione	100,00%
Contro la direzione	0,00%

I dati si basano sull'approccio generale di State Street Global Advisors relativamente al voto di fine trimestre sulle società detenute dal Fondo. Queste informazioni non sostituiscono una relazione sui voti per delega, che può essere richiesta al Responsabile delle relazioni.

Il programma di asset stewardship di State Street Global Advisors (SSGA) mira a interagire con le nostre società di fondi su questioni che influenzano la creazione di valore di lungo periodo attraverso considerazioni in materia ambientale, sociale e di governance (ESG). Nel recente passato, SSGA ha messo a disposizione linee guida dettagliate riguardanti questioni di governance fondamentali come, per esempio, una leadership efficace e indipendente del consiglio di amministrazione. L'obiettivo attuale di SSGA consiste nell'aiutare i consigli di amministrazione a riflettere sul potenziale impatto di questioni ambientali e sociali, integrando considerazioni sulla sostenibilità nelle attività di vigilanza del consiglio sulle strategie di lungo termine, come buona prassi aziendale.

Diversità di genere	
Donne nel Consiglio di amministrazione	Numero di titoli
0	0
1	0
2	3
3	12
4	19
5	9
6	6
7	1
8	0
9	0
10	0
10+	0
Non disponibile	150
Totale	200

Fonte: Factset/SSGA al 31 ago 2024.

ssga.com/etfs

Le informazioni sulla Sostenibilità presentate nelle pagine seguenti sono fornite solo a scopo informativo. Queste informazioni intendono fornire trasparenza agli investitori riguardo alle caratteristiche di sostenibilità del fondo. La presentazione di queste informazioni non deve essere interpretata come una rappresentazione dell'obiettivo di investimento attuale o futuro del fondo, né deve essere vista come un indicatore delle decisioni di investimento attuali o future del gestore del fondo. Per informazioni relative alla categoria SFDR del fondo, gli investitori sono incoraggiati a consultare il [prospetto/KIID] del fondo. Questo fondo non mira a seguire una strategia di investimento sostenibile o di riduzione dell'impatto ambientale. Gli investitori non dovrebbero valutare un investimento nel fondo basandosi esclusivamente sulle informazioni di cui sopra, ma piuttosto dovrebbero considerare altri fattori, tra cui l'obiettivo di investimento complessivo del fondo e il profilo di rischio. Per ulteriori informazioni sul fondo, si invitano gli investitori a consultare il [https://www.ssga.com/fund-finder?tab=documents]] del fondo. Le informazioni di terzi di cui sopra sono state ottenute da fonti ritenute affidabili alla data indicata, ma la loro accuratezza non è garantita. SSGA non è responsabile delle decisioni di investimento basate su queste informazioni e non si deve fare affidamento su di esse come tali. Non vi è alcuna dichiarazione o garanzia circa l'attuale accuratezza, affidabilità o completezza di queste informazioni.

Il Fattore R™ Il Fattore R™ è un sistema di punteggio ESG che sfrutta quadri trasparenti e di uso comune di valutazione della rilevanza, supportati da un ampio gruppo di società e investitori al fine di generare un punteggio ESG unico per le società quotate. Il punteggio è alimentato da dati ESG provenienti da quattro fornitori diversi (Sustainalytics, ISS-Oekom, Vigeo-EIRIS, e ISS-Governance), al fine di migliorare la copertura complessiva ed eliminare gli errori intrinseci delle metodologie di classificazione esistenti. Il Fattore R™ è progettato per attribuire alle società il potere di contribuire alla creazione di mercati sostenibili. I Punteggi del **Fattore R™** sono confrontabili in tutti i settori. I punteggi ESG e Corporate Governance (CorpGov) sono progettati sulla base di questioni rilevanti per l'area di

regolamentazione e il settore di una società. Una scala di valutazione uniforme permette di interpretare il punteggio di livello finale della società, per consentire confronti tra le diverse società. Il processo di assegnazione di un punteggio del **Fattore R™** è costituito da due componenti sottostanti. Il primo componente si basa sul quadro pubblicato dal Sustainability Accounting Standards Board ("SASB"), che è utilizzato per tutti gli aspetti ESG del punteggio diversi da quelli relativi alle questioni di governance aziendale. Il quadro SASB cerca di identificare i rischi ESG che sono determinanti in ambito finanziario per l'emittente, sulla base della sua classificazione settoriale. Questo componente del punteggio del Fattore R™ è determinato utilizzando esclusivamente i parametri dei fornitori di dati ESG che riguardano specificamente i rischi ESG identificati dal quadro SASB, identificati come determinanti in ambito finanziario per l'emittente, sulla base della sua classificazione settoriale. Il secondo componente del punteggio, il punteggio CorpGov, è generato utilizzando codici di corporate governance specifici della regione, sviluppati da investitori o regolatori. I codici di governance descrivono le aspettative minime, in termini di corporate governance, di una particolare regione e di norma attengono a temi quali i diritti degli azionisti, l'indipendenza del consiglio di amministrazione e la retribuzione della dirigenza. Questo componente del Fattore R™ utilizza dati forniti da ISS Governance per assegnare un punteggio di governance agli emittenti secondo tali codici di governance.

Profilo del Fattore R All'interno di ciascun gruppo settoriale, gli emittenti sono classificati in base a cinque diversi gruppi di performance ESG, sulla base del percentile in cui si collocano i loro punteggi del Fattore R™. Ogni società è classificata in una delle cinque classi di performance ESG (Fanalino di coda: 10% dell'universo; Sottoperformance: 20% dell'universo; Performance intermedia: 40% dell'universo; Sovraperformance: 20% dell'universo; Leader: 10% dell'universo), valutando il punteggio del Fattore R™ della società rispetto a una fascia. I punteggi del Fattore R™ vengono normalmente distribuiti utilizzando valutazioni normalizzate su una scala di valutazione da 0 a 100. Può verificarsi una discrepanza tra il numero di posizioni riportate nel Riepilogo R-Factor™ e il

numero di posizioni nella reportistica periodica, in quanto il dato sul Riepilogo R-Factor™ è conteggiato in base al numero di emittenti piuttosto che al numero di posizioni in portafoglio.

Green Revenue (%) Percentuale dei ricavi derivati da prodotti/attività con tecnologia green o low carbon, come classificati dal sistema FTSE LCE

Brown Revenue (%) Percentuale dei ricavi derivati da settori "brown", settori estrattivi così come classificati da S&P Trucost

Intensità di carbonio media ponderata TCFD - Esposizione del portafoglio a società ad alta intensità di carbonio, espressa in tonnellate CO₂e / mln USD di ricavi. Le emissioni di gas serra Scope 1 e Scope 2 sono allocate in base ai pesi del portafoglio (il valore corrente dell'investimento rispetto al valore corrente del portafoglio).

Emissioni totali di carbonio TCFD - Le emissioni assolute di gas a effetto serra associate a un portafoglio, espresse in tonnellate di CO₂e. Le emissioni di gas serra Scope 1 e Scope 2 sono assegnate agli investitori in base a un approccio di proprietà azionaria.

Impronta di carbonio TCFD - Emissioni totali di carbonio per un portafoglio normalizzato per il valore di mercato del portafoglio, espresso in tonnellate CO₂e / mln USD investiti. Le emissioni di gas serra Scope 1 e Scope 2 sono assegnate agli investitori in base a un approccio di proprietà azionaria.

Intensità di carbonio TCFD - Volume di emissioni di CO₂ per milione di dollari di ricavi (efficienza in termini di un portafoglio), espresso in tonnellate CO₂e / mln USD di ricavi. Le emissioni di gas serra Scope 1 e Scope 2 sono assegnate agli investitori in base a un approccio di proprietà azionaria

Diversità di genere Al momento utilizziamo il set di dati "People" di Factset per comunicare il numero di donne presenti nel consiglio di amministrazione di ciascuna società del portafoglio del Fondo.

Dati e parametri sono stati ottenuti come segue, dai seguenti collaboratori, alla data della presente relazione e sono soggetti alle relative informative sotto riportate. Tutti gli altri dati sono stati ottenuti da SSGA.

Sezioni Trucost Intensità di Carbonio (diretta+indiretta), Intensità di Carbonio Media Ponderata (diretta+indiretta), Emissioni di Carbonio Totali, Carbon Footprint. Trucost® è un

marchio registrato di S&P Trucost Limited ("Trucost") ed è utilizzato su licenza. Il/Report ESG non è/sono in alcun modo sponsorizzato/i, approvato/i, venduto/i o promosso/i da Trucost o dalle sue affiliate (insieme le "Parti Licenzianti") e nessuna delle Parti Licenzianti avanza alcuna pretesa, previsione, garanzia o dichiarazione di alcun tipo, espressamente o implicitamente, sia per quanto riguarda (i) i risultati ottenibili dall'utilizzo dei dati Trucost con il report, sia (ii) l'idoneità dei dati Trucost per lo scopo per il quale vengono messi in relazione con il report. Nessuna delle Parti Licenzianti fornisce consulenza o raccomandazione finanziaria o di investimento in relazione al report. Nessuna delle Parti Licenzianti sarà responsabile (per negligenza o altro) nei confronti di qualsiasi persona per qualsiasi errore nei dati Trucost o per l'obbligo di avvisare qualsiasi persona di eventuali errori ivi contenuti.

Sezioni FactSet diversità di genere La presente pubblicazione potrebbe contenere informazioni proprietarie di FactSet ("Informazioni di FactSet") che non possono essere riprodotte, utilizzate, divulgate, modificate o pubblicate in alcun modo senza previo consenso esplicito scritto di FactSet. Le Informazioni di FactSet sono fornite "così come sono" e tutte le dichiarazioni e garanzie, sia scritte che orali, esplicite o implicite (per legge, statuto o altro) sono nella presente escluse e negate, nella più ampia misura consentita dalla legge. In particolare, per quanto riguarda le Informazioni di FactSet, FactSet nega qualsiasi garanzia implicita di commerciabilità e idoneità per finalità particolari e non offre alcuna garanzia in materia di accuratezza, completezza, tempestività, funzionalità e/o affidabilità. Le Informazioni di FactSet non costituiscono una consulenza di investimento e qualsiasi opinione o affermazione contenuta in una pubblicazione riportante le Informazioni di FactSet (e/o le Informazioni di FactSet stesse) non rappresenta le opinioni o le convinzioni di FactSet, delle sue affiliate e/o entità connesse, e/o di qualsiasi loro dipendente. FactSet non è responsabile di alcun danno derivante dall'utilizzo, in qualsivoglia maniera, della presente pubblicazione o delle Informazioni di FactSet che potrebbero essere ivi contenute.

© 2024 State Street Corporation.
Tutti i diritti riservati.
Data di scadenza: 30/09/2025