

**Vorlage —Regelmäßige 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 eine Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist, und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

**Name des Produkts:**  
L&G Global Thematic ESG Exclusions UCITS ETF

**Unternehmenskennung (LEI-Code):**  
213800329VJE5GPXYB89

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

### Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

**Ja**

**Nein**

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: \_\_ %

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

Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: \_\_ %

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 51,87 % an nachhaltigen Investitionen

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 wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder

### Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die folgenden ökologischen Merkmale im Zusammenhang mit dem Klimawandel:

- Vermeidung von Investitionen in bestimmte fossile Brennstoffe; und
- Unterstützung von erneuerbaren Energien.

Der Fonds bewarb die folgenden sozialen Merkmale, die sich auf soziale Normen und Standards beziehen:

sozialen Merkmale erreicht werden.

- Menschenrechte, Arbeitsrechte und Korruptionsbekämpfung, wie sie in den Grundsätzen des UN Global Compact festgelegt sind; und
- Vermeidung der Finanzierung umstrittener Waffen.

Der Fonds förderte die oben genannten Eigenschaften durch die Nachbildung des Solactive L&G Global Thematic Index (der „Index“), der als Referenzbenchmark für die zur Erreichung der vom Fonds geförderten ökologischen und sozialen Merkmale festgelegt ist. Obwohl ökologische und soziale Merkmale durch die Anwendung der unten dargelegten nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie beworben werden, sei der Anleger darauf hingewiesen, dass diese ökologischen und sozialen Merkmale keine nachhaltigen Investitionsziele darstellen.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Nachhaltigkeitsindikator	Wertentwicklung
1. Der Anteil des relevanten Vergleichsindex, der unter Anwendung der unten aufgeführten <b>Ausschlusskriterien</b> ausgeschlossen wurde	„Dieser Fonds hat keinen veröffentlichten Hauptindex, sein breit angelegtes Universum besteht jedoch aus einer Reihe von Unternehmen aus thematisch miteinander zusammenhängenden Bereichen, die von Research-Experten für den jeweiligen Bereich ausgewählt werden. Bei diesem von Solactive verwalteten und berechneten Index betrug der Anteil der aufgrund der ESG-Ausschlusskriterien des Index ausgeschlossenen Beteiligungen 5,69 %.  Bei Anwendung der geltenden Ausschlüsse auf das gesamte zulässige Anlageuniversum wären vorbehaltlich Liquiditäts- und Handelsbeschränkungen 11,91 % der Positionen ausgeschlossen worden.“

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Da es sich um die erste Berichtsperiode mit Nachhaltigkeitskennzahlen handelt, ist kein Vergleich möglich.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Der Fonds verfolgte kein nachhaltiges Anlageziel.

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

● ***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Obwohl der Fonds keine Verpflichtung eingegangen ist, in nachhaltigen Investitionen zu investieren, hat der Anlageverwalter eine firmeneigene Methode zur Identifizierung beiläufig entstandener nachhaltiger Investitionen angewendet, derzufolge keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt wurden (Beurteilung nach dem Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“). Mit dieser Methode wurden potenzielle nachhaltige Investitionen im Hinblick auf Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, die Beteiligung an bestimmten Produkten und Dienstleistungen und bestimmte Kontroversitätsbewertungen geprüft. Als Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen werden die in Tabelle 1 des Anhangs I der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission aufgeführten Kennzahlen herangezogen (die „SFDR-Kennzahlen der Stufe 2“). Die Bewertungen der Kontroversen spiegeln den Grad der Verwicklung eines Emittenten in Vorfälle mit nachteiligen Auswirkungen auf Umwelt, Gesellschaft und Unternehmensführung wider. Der Anlageverwalter schloss Wertpapiere aus seiner Berechnung nachhaltiger Investitionen aus, die bei den oben genannten Beurteilungen nicht die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte erreichten.

*Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*

Wie oben beschrieben, wurden Nachhaltigkeitsindikatoren für nachteilige Auswirkungen, wie in Tabelle 1 des Anhangs I der SFDR dargelegt, in die Methode für nachhaltige Investitionen einbezogen, indem Wertpapiere aus dieser Berechnung ausgeschlossen wurden, die die vorab festgelegten quantitativen und qualitativen Schwellenwerte nicht erfüllten.

*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:*

Ja, die normenbasierte Prüfung im Rahmen der DNSH-Bewertung nachhaltiger Investitionen berücksichtigt die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.

*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 Unionskriterien beigefügt.*

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.*



## Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bei der Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds gemäß den Angaben im nachstehenden Abschnitt „Welche Maßnahmen wurden zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?“ sowie gemäß der Beschreibung der Anlagestrategie in den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds. So verwendete der Fonds beispielsweise den Indikator „Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen“, um die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Bezug auf die in den UNGC-Grundsätzen dargelegten sozialen Belange zu ermitteln, und ergriff Maßnahmen in Bezug auf die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die bei der Implementierung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie ermittelt wurden.

<b>Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen</b>
PAI 4: Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
PAI 5: Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen
PAI 10: Verstöße gegen die UNGC- Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen
PAI 14: Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: Von 1. Juli 2022 bis 30. Juni 2023

## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
DELTA ELECTRONICS INC TWD 10.0	Industriewerte	0,95	Taiwan
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES I USD 0.0001	Energie	0,94	USA
SUMITOMO ELECTRIC INDUSTRIES LT NPV	Nichtbasiskonsumgüter	0,89	Japan
TESLA INC USD 0.001	Nichtbasiskonsumgüter	0,87	USA
PING IDENTITY HLDG CORP USD 0.001	Finanzen	0,85	USA
PILBARA MINERALS LTD NPV	Grundstoffe	0,83	Australien
ALNYLAM PHARMACEUTICALS IN USD 0.01	Basiskonsumgüter	0,82	USA
IONIS PHARMACEUTICALS INC USD 0.001	Basiskonsumgüter	0,82	USA
VERTEX PHARMACEUTICALS INC USD 0.01	Basiskonsumgüter	0,81	USA
MINERAL RESOURCES LTD NPV	Grundstoffe	0,80	Australien
IONQ INC USD 0.0001	Technologie	0,77	USA
RENAULT SA EUR 3.81	Nichtbasiskonsumgüter	0,77	Frankreich
BIOGEN INC	Basiskonsumgüter	0,73	USA
BIOMARIN PHARMACEUTICAL I USD 0.001	Basiskonsumgüter	0,73	USA
ENERSYS USD 0.01	Industriewerte	0,72	USA

Die oben genannten 15 größten Positionen entsprechen dem gewichteten Durchschnitt über vier Quartale im Portfolio des Fonds während des Berichtszeitraums.

Grundlage für die Positionen waren Daten der Verwaltungsstelle, die Barmittel und gegebenenfalls derivative Instrumente umfassten.

Daten von Drittanbietern bilden die Grundlage für die in diesem Abschnitt verwendeten Berechnungen. Daten von Drittanbietern werden unter Lizenz und mit der rechtskräftigen Genehmigung der Datenanbieter verwendet. Obwohl alle angemessenen Anstrengungen unternommen werden, um sicherzustellen, dass die bereitgestellten Daten korrekt sind, ist unbedingt zu beachten, dass die externen Datenanbieter keine Verantwortung für Fehler oder Auslassungen übernehmen und nicht für Schäden haftbar gemacht werden können, die aus der Verwendung ihrer Daten in den Berechnungen und dem Vertrauen entstehen, das Sie auf die Berechnungen setzen.



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

## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

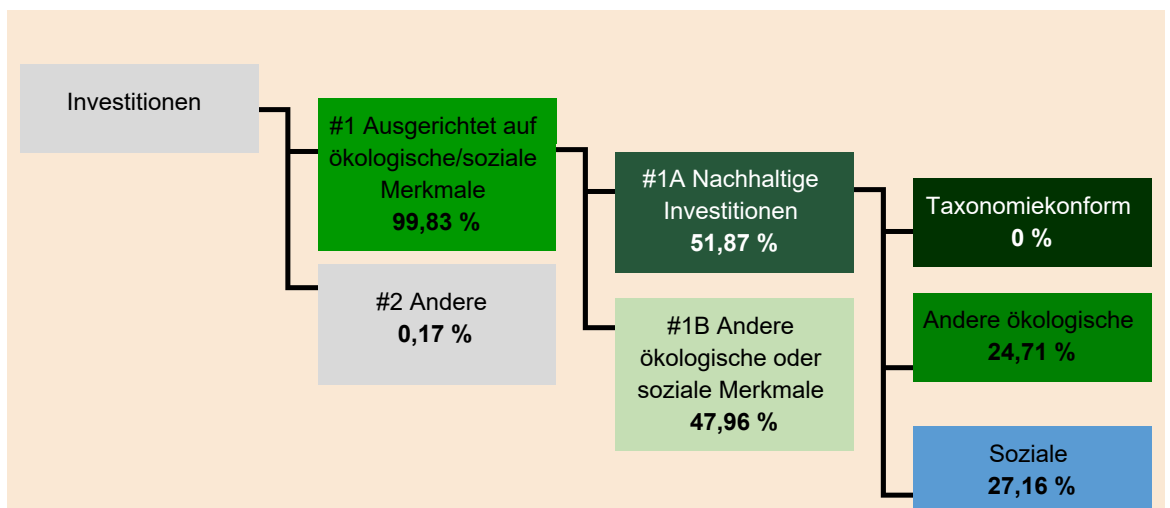
Im Folgenden finden sich Informationen darüber, welcher Anteil des Fonds ökologische/soziale Merkmale beworben hat und welcher Anteil des Fonds im Bezugszeitraum in nachhaltige Investitionen investierte.

### ● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Fonds investierte 99,83 % seines Portfolios in Investitionen, die mit den von ihm beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen konform waren (#1). Der restliche Teil der Investitionen wurde nicht zur Erreichung der ökologischen und sozialen Merkmale verwendet und fiel unter #2 Andere Investitionen. Der Zweck des übrigen Teils der Investitionen, einschließlich einer Beschreibung der etwaigen ökologischen oder sozialen Mindestschutzmaßnahmen, wird im Folgenden dargelegt.

Der Fonds hatte keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel, aber 51,85 % der Investitionen des Fonds entfielen auf nachhaltige Investitionen.

Die Vermögensallokation reflektiert das Portfolio des Fonds zum Ende des Berichtszeitraums.



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

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

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Es wurde in die folgenden Branchen investiert. Die Wirtschaftssektoren basieren auf Daten der Verwaltungsstelle und entsprechen den 15 größten Positionen des Fonds.

<b>Wirtschaftssektor</b>	<b>Teilektor</b>	<b>%</b>
Basiskonsumgüter	Biotechnologie	12,33
Technologie	Software	9,35
Basiskonsumgüter	Gesundheitsprodukte	7,56
Basiskonsumgüter	Pharmazeutische Produkte	6,37
Technologie	Computer	5,82
Industriewerte	Maschinen – Diversifiziert	5,46
Energie	Alternative Energiequellen	5,11
Nichtbasiskonsumgüter	Automobilhersteller	4,85
Kommunikation	Internet	4,71
Industriewerte	Transport	4,48
Technologie	Halbleiter	3,90
Andere	Andere	30,06

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO<sub>2</sub>-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

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

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemission swerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



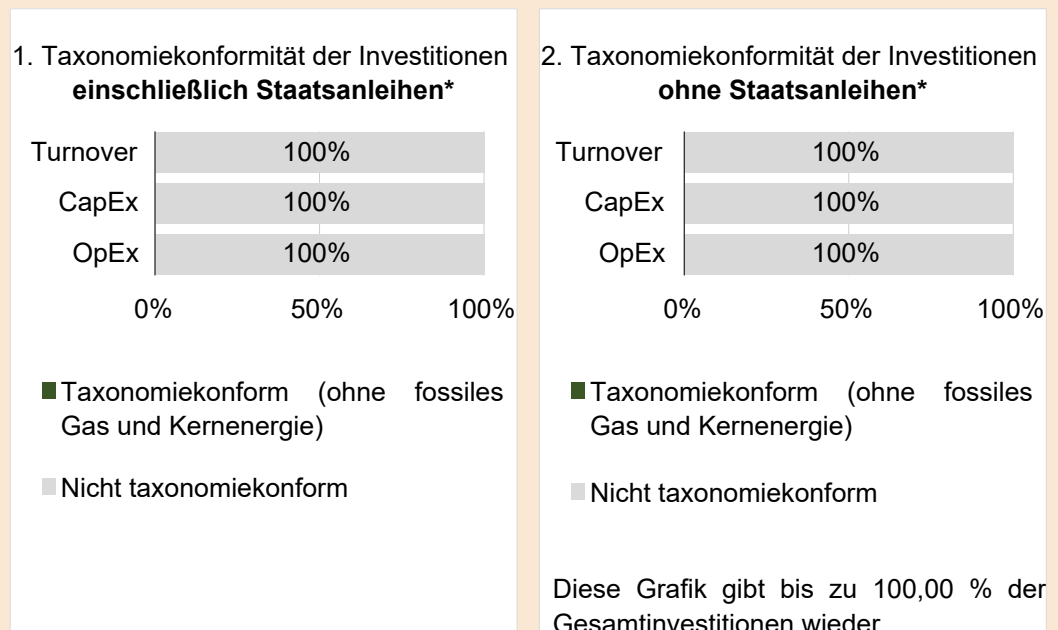
## Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Fonds hatte sich nicht verpflichtet, mehr als 0 % seiner Vermögenswerte in Investitionen zu investieren, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Das tatsächliche Engagement des Fonds in Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, betrug 0 %.

### Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>(1)</sup>?

- Ja:
- In fossiles Gas
  - In Kernenergie
- Nein

*Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



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

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



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.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



### ● **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Der Fonds investierte 24,71 % seines Portfolios in nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel.



### ● **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Fonds investierte 27,16 % seines Portfolios in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel.



### ● **Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Zu den sonstigen Anlagen zählten Barmittel, Hinterlegungsscheine, Geldmarktfonds und Derivate. Diese Anlagen wurden für Anlagezwecke und ein effizientes Portfoliomanagement verwendet. Derivate konnten auch zur Währungsabsicherung für währungsgesicherte Aktienklassen eingesetzt werden. Die vom Index verwendeten Umwelt- oder Sozialschutzmaßnahmen wurden nur auf Instrumente angewandt, mit denen ein Engagement in einem Indexbestandteil erreicht

### ● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds verpflichtete sich nicht, in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten zu investieren. Es besteht die Ansicht, dass das Engagement des Fonds in Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten 0 % betrug.

wird.

Im Rahmen der Bewertung des Kreditrisikoprofils seiner wichtigsten Geschäftspartner berücksichtigte der Investmentmanager ESG-Faktoren, einschließlich der Analyse der einschlägigen Methoden für verantwortungsvolle Investitionen. Der Anlageverwalter verfügte über einen internen Kontrollmechanismus, um angemessene Maßnahmen für den Fall zu ergreifen, dass ein wichtiger Geschäftspartner die vom Anlageverwalter festgelegten Mindeststandards in Bezug auf solche ESG-Faktoren nicht einhält.



## **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Der Fonds bildet den anwendbaren Index nach:

**ESG-erweiterte Ausschlüsse:** Der Index schließt Unternehmen aus, die (i) den UN Global Compact nicht einhalten, (ii) im Zusammenhang mit einer umstrittenen Angelegenheit stehen (d. h. Unternehmen, die in Ereignisse verwickelt sind, die schwerwiegende Auswirkungen auf die Umwelt und die Gesellschaft haben und für das Unternehmen ein ernsthaftes Geschäftsrisiko darstellen), (iii) an der Herstellung oder dem Verkauf von Tabak oder einem damit verbundenen Produkt/Dienstleistung, (iv) an militärischen Vertragswaffen oder damit zusammenhängenden Produkten, (v) direkt oder indirekt durch Unternehmenseigentum an umstrittenen Waffen, (vi) am Einzelhandel oder Vertrieb von Kleinwaffen an Zivilisten (Angriffs- und Nichtangriffswaffen) und an Kunden aus dem militärischen Bereich bzw. der Strafverfolgung sowie an Schlüsselkomponenten von Kleinwaffen, (vii) an der Gewinnung und Verstromung von Kraftwerkskohle beteiligt sind oder die Stromerzeugungskapazität von Kohle erhöhen, (viii) an der Gewinnung, Produktion oder Kapazitätserhöhung von konventionellem Erdöl und Erdgas oder damit zusammenhängenden Produkten/Dienstleistungen, (ix) an der Gewinnung von Ölsand, der Exploration/Extraktion von arktischem Erdöl und Erdgas, der Gewinnung von Schiefergas oder der Kapazitätserhöhung von unkonventionellem Erdöl und Erdgas, (x) an der Produktion, dem Vertrieb, den unterstützenden Produkten oder der Kapazitätserweiterung von Kernenergie, (xi) an der Produktion, dem Einzelhandel oder den damit verbundenen Dienstleistungen/Produkten von Alkohol, (xii) am Betrieb, der Spezialausrüstung oder den unterstützenden Produkten/Dienstleistungen von Glücksspielen und (xiii) an der Produktion oder dem Vertrieb von Unterhaltung für Erwachsene beteiligt sind.

Diese Ausschlüsse und die Definition des Begriffs „Beteiligung“ wurden vom Indexanbieter festgelegt und auf der Website der Solactive AG <https://www.solactive.com/indices/?index=DE000SL0F799> näher erläutert.

Das unternehmensweite Engagement-Programm von LGIM deckt verschiedene Themen und Probleme ab, darunter Klimawandel, Vergütung, Geschlechtervielfalt, Humankapital, Audits, Cybersicherheit usw., die unabhängig von der Kapitalstruktur sind. Die Zusammensetzung der Leitungs- und Kontrollorgane wird zwar von Aktionären und Aktionärsrechten beeinflusst, ist aber auch für Gläubiger relevant, um sicherzustellen, dass die Leitungs- und Kontrollorgane über die für eine Beaufsichtigung der Führung und Strategie der Organisation erforderliche Expertise und Unabhängigkeit verfügen.

Die unternehmensweite Stewardship-Richtlinie von LGIM finden Sie hier: [https://www.lgim.com/landg-assets/lgim/\\_document-library/capabilities/lgim-global-corporate-governance-and-responsible-investment-principles.pdf](https://www.lgim.com/landg-assets/lgim/_document-library/capabilities/lgim-global-corporate-governance-and-responsible-investment-principles.pdf)

Weitere Einzelheiten zur nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds finden Sie in den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds in der Beschreibung der Anlagestrategie.



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

## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bitte beachten Sie die untenstehende Antwort zu diesem Abschnitt.

### ● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Der Index weicht aufgrund der oben beschriebenen nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie vom relevanten breiten Marktindex ab. Die Umsetzung der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie führt aufgrund der angewandten Ausschlüsse und der Auswirkungen auf die Gewichtungen der Indexbestandteile dazu, dass das Anlageuniversum kleiner ist als das des breiten Marktindex.

### ● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Durch die Nachbildung des Index bot der Fonds ein Engagement in Emittenten gemäß der nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie und bewarb die oben beschriebenen ökologischen und sozialen Merkmale. Die oben genannten Nachhaltigkeitsindikatoren zeigen, wie sich der Index und damit der Fonds entwickelten.

### ● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Der geschätzte voraussichtliche Tracking Error für den Fonds beträgt unter normalen Marktbedingungen 0,35 % (annualisiert). Dies entspricht der erwarteten Schwankung der Differenz zwischen der Rendite des Fondsportfolios und der Rendite des Index. Bei Zugrundelegung der monatlichen Renditen während des Berichtszeitraums betrug der annualisierte Ex-ante Tracking Error des Fonds 0,18 % und liegt damit innerhalb des oben angegebenen erwarteten Ex-ante Tracking Error.

### ● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Bitte beachten Sie die Entwicklung der oben beschriebenen Nachhaltigkeitsindikatoren sowie die Gegenüberstellung mit dem Vergleichsindex, bei dem es sich um einen breiten Marktindex handelt.