

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 Gerd Kommer Multifactor Equity UCITS ETF

Unternehmenskennung (LEI-Code):
213800CV82UI52564294

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

X 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 18,58 % 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:

- Verringerung der Intensität der Treibhausgasemissionen;
- 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

sozialen Merkmale erreicht werden.

beziehen:

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

Der Fonds wurde passiv verwaltet und bewarb die oben genannten Merkmale, indem er den Solactive Gerd Kommer Multifactor Equity Index NTR (der „Index“) nachbildete, der als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale bestimmt war. Obwohl durch die Anwendung der nachfolgend beschriebenen nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie ökologische und soziale Merkmale beworben wurden, ist zu beachten, dass diese ökologischen und sozialen Merkmale keine nachhaltigen Anlageziele darstellen.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Nachhaltigkeitsindikator	Wertentwicklung
1. Der Anteil des relevanten *Vergleichsindexes, der unter Anwendung der unten aufgeführten Ausschlusskriterien ausgeschlossen wurde	5,05 % * Vergleichsindex: Solactive GBS Global Markets Investable Universe USD Index NTR

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.

Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen
PAI 3: THG-Emissionsintensität der Unternehmen
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 16. Juni 2023 bis 30. Juni 2023

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
NIPPON TELEGRAPH + TELEPHONE CO NPV	Kommunikation	3,45	Japan
META PLATFORMS INC USD 0.000006	Kommunikation	1,11	USA
MICROSOFT CORP USD 0.0000125	Technologie	1,11	USA
APPLE INC USD 0.00001	Technologie	1,10	USA
EXXON MOBIL CORP NPV	Energie	0,92	USA
CHEVRON CORP USD 0.75	Energie	0,79	USA
NVIDIA CORP USD 0.001	Technologie	0,72	USA
BROADCOM INC NPV	Technologie	0,60	USA
ALPHABET INC CLASS A	Kommunikation	0,57	USA
ALPHABET INC CLASS C	Kommunikation	0,54	USA
SAMSUNG ELECTRONICS CO LT KRW 100.0	Technologie	0,52	Südkorea
SHELL PLC EUR 0.07	Energie	0,49	Vereinigtes Königreich
AMAZON COM INC USD 0.01	Kommunikation	0,47	USA
ACCENTURE PLC USD 0.000023	Technologie	0,46	Irland
LVMH MOET HENNESSY LOUI EUR 0.3 RFD	Nichtbasiskonsumgüter	0,46	Frankreich

Die oben genannten 15 größten Positionen entsprechen dem Portfolio des Fonds zum Ende des Berichtszeitraums. Dies ist repräsentativ für das am 21. Juni 2023 aufgelegte Fondsportfolio.

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?

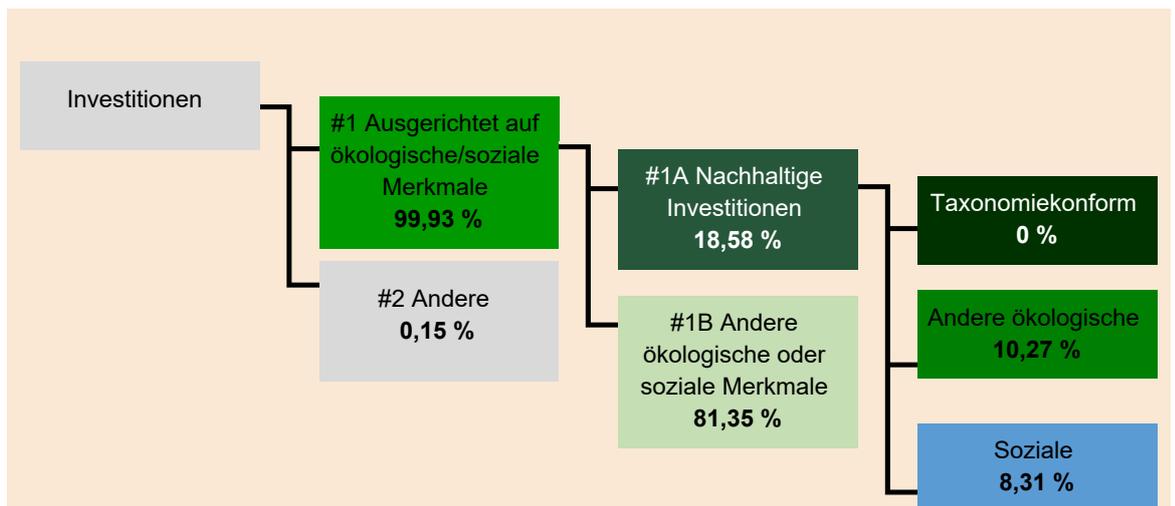
Im Folgenden finden sich Informationen darüber, welcher Anteil des Fonds ökologische/soziale Merkmale beworben hat und welcher Anteil des Fonds im Bezugszeitraum in nachhaltige Investitionen investierte.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Der Fonds investierte 99,93 % 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 18,58 % 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.

Wirtschaftssektor	Teilsektor	%
Finanzen	Banken	7,72
Kommunikation	Telekommunikation	6,76
Energie	Öl und Gas	6,71
Kommunikation	Internet	5,97
Technologie	Halbleiter	5,39
Finanzen	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	4,71
Basiskonsumgüter	Pharmazeutische Produkte	4,18
Technologie	Software	3,97
Technologie	Computer	3,27
Finanzen	Versicherung	3,24
Nichtbasiskonsumgüter	Retail	2,95
Andere	Andere	45,14

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-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 CO2- armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemission swerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



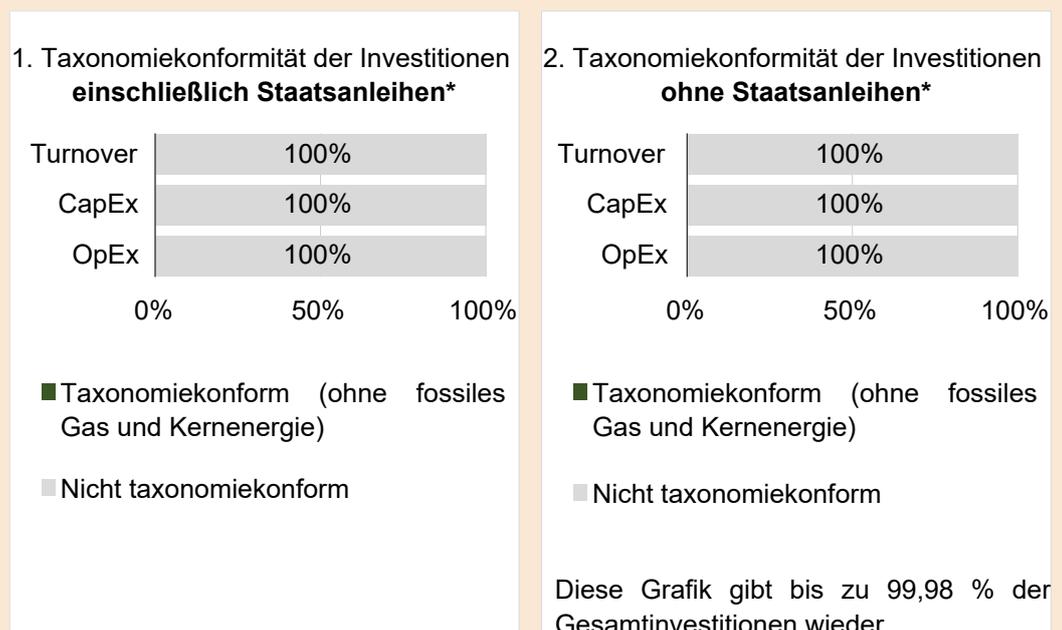
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

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⁽¹⁾?

- 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.

1 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.

● **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.

● **Wie hat sich der Anteil der EU-taxonomiekonformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Dies ist die erste Berichtsperiode, sodass keine Vergleichswerte verfügbar sind.



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 10,27 % 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 8,31 % seines Portfolios in sozial nachhaltige Emittenten, verpflichtete sich jedoch nicht zu einem Mindestanteil solcher Investitionen.



● **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 können 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 wurde.

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 bildete den anwendbaren Index nach:

ESG-Ausschlüsse: Der Index schließt Unternehmen aus, die (i) nicht mit dem Globalen Pakt der Vereinten Nationen konform sind, (ii) mit einer Kontroverse in Verbindung gebracht werden (d. h. Unternehmen, die in Ereignissen verwickelt waren, die schwerwiegende Auswirkungen auf Umwelt und Gesellschaft haben und für das Unternehmen ernsthafte Geschäftsrisiken darstellen), (iii) direkte Beteiligung an umstrittenen Waffen haben oder (iv) Beteiligungen an der Gewinnung von Kraftwerkskohle, der Kohleverstromung oder damit verbundenen Produkten/Dienstleistungen aufweisen. Darüber hinaus schließt der Index auch Unternehmen mit einer hohen Kohlenstoffintensität aus.

Diese Ausschlüsse und die Definition des Begriffs „Beteiligung“ werden 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

Weitere Einzelheiten zur nachhaltigkeitsbezogenen Anlagestrategie des Fonds können Sie den vorvertraglichen Unterlagen des Fonds entnehmen.



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 0,04 % 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.