

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

Name des Produkts:
UBS S&P 500 ESG ELITE UCITS ETF

Unternehmenskennung:
549300R5VCVH48KS7Z06

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☒ ☐ **Ja**

☐ 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: ____%

☒ ☐ **Nein**

☒ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 87,53 % 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**

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

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Die beworbenen ESG-Merkmale werden jeweils anhand der folgenden Indikatoren gemessen:

Basierend auf dem täglichen Durchschnittswert aus dem letzten Quartal des Geschäftsjahres war die ESG-Bewertung (ESG-Score) 14,70 % höher als die des übergeordneten Referenzwerts (S&P 500 Index) (7,18 gegenüber 6,26).



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

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

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die von dem Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Basierend auf dem täglichen Durchschnittswert aus dem letzten Quartal des Geschäftsjahres war eine kombinierte durchschnittliche Scope-1- und -2-CO₂-Intensität 50,97 % niedriger als die des übergeordneten Referenzwerts (S&P 500 Index) (42,44 gegenüber 86,56).

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

2025/2024:

Die ESG-Bewertung (MSCI ESG Score) war zum 31. Dezember 2025 um 2,58 % niedriger als zum 31. Dezember 2024 (7,18 gegenüber 7,37).

Die kombinierte gewichtete durchschnittliche Scope-1- und -2-CO₂-Intensität war zum 31. Dezember 2025 um 35,14 % niedriger als zum 31. Dezember 2024 (42,44 gegenüber 65,43).

2024/2023:

Die ESG-Bewertung (MSCI ESG Score) entsprach zum 31. Dezember 2024 der zum 31. Dezember 2023. (7,37 gegenüber 7,37)

Die kombinierte gewichtete durchschnittliche Scope-1- und -2-CO₂-Intensität war zum 31. Dezember 2024 um 2,20 % höher als zum 31. Dezember 2023. (65,43 gegenüber 64,02)

2023/2022:

Die ESG-Bewertung (MSCI ESG Score) war zum 31. Dezember 2023 um 5,40 % höher als zum 31. Dezember 2022. (7,37 gegenüber 6,99)

Die kombinierte gewichtete durchschnittliche Scope-1- und -2-CO₂-Intensität war zum 31. Dezember 2023 um 5,52 % niedriger als zum 31. Dezember 2022. (64,02 gegenüber 67,76)

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

In den Referenzindex ist das Global Standards Screening (GSS) von Sustainalytics einbezogen, wodurch Emittenten zeitnah ausgefiltert werden, die gegen internationale Normen und Standards verstoßen. Den GSS-Beurteilungen liegen die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen zugrunde.

GSS ist so konzipiert, dass es zeitnahe, einheitliche Einschätzungen zu ESG-Kontroversen liefert, an denen Emittenten beteiligt sind. An jedem Bezugstermin für die Neugewichtung kommen gemäß Sustainalytics als nicht konform eingestufte Unternehmen nicht zur Indexaufnahme infrage. Nicht von Sustainalytics erfasste Unternehmen kommen, solange sie nicht entsprechend erfasst sind, ebenfalls nicht für eine Indexaufnahme infrage.

Das GSS überwacht die Beteiligung von Unternehmen an nennenswerten ESG-Kontroversen im Zusammenhang mit dem Betrieb des Unternehmens und/oder Produkten, mögliche Verstöße gegen internationale Normen und Prinzipien wie den Globalen Pakt der Vereinten Nationen, die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Bezug auf diese Normen und Prinzipien.

Des Weiteren schließt das Finanzprodukt Investitionen in Unternehmen aus, die direkt oder indirekt an den folgenden Geschäftstätigkeiten beteiligt sind: Umstrittene Waffen, Rüstungsaufträge, Kraftwerkskohle, Tabak, Ölsande, Schieferenergie, arktische Öl- und Gasexploration, Öl und Gas, Handfeuerwaffen, Erwachsenenunterhaltung, Alkohol, Glücksspiel, genetisch modifizierte Pflanzen und Saatgut, Atomwaffen, unlautere Kreditvergaben und Palmöl.

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

Dieses Finanzprodukt wird passiv verwaltet und bildet einen Index nach. Der Indexanbieter setzt die vorstehend dargelegten Prüfungen und Ausschlüsse um, um sicherzustellen, dass der verbleibende Anteil des Index, bei dem es sich um nachhaltige Investitionen handelt, keine erheblichen Beeinträchtigungen verursacht.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, die in Tabelle 1 von Anhang 1 der Verordnung (EU) 2022/1288 genannt sind, werden vom Indexanbieter bei der Anwendung von wert- und normenbasierten Ausschlüssen, wie in der Indexmethodik und nachfolgend dargelegt, berücksichtigt.

In den Indizes ist das Global Standards Screening (GSS) von Sustainalytics einbezogen, wodurch Emittenten zeitnah ausgefiltert werden, die gegen internationale Normen und Standards verstoßen. Den GSS-Beurteilungen liegen die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen zugrunde.

GSS ist so konzipiert, dass es zeitnahe, einheitliche Einschätzungen zu ESG-Kontroversen liefert, an denen Emittenten beteiligt sind. An jedem Bezugstermin für die Neugewichtung kommen gemäß Sustainalytics als nicht konform eingestufte Unternehmen nicht zur Indexaufnahme infrage. Nicht von Sustainalytics erfasste Unternehmen kommen, solange sie nicht entsprechend erfasst sind, ebenfalls nicht für eine Indexaufnahme infrage.

Das GSS überwacht die Beteiligung von Unternehmen an nennenswerten ESG-Kontroversen im Zusammenhang mit dem Betrieb des Unternehmens und/oder Produkten, mögliche Verstöße gegen internationale Normen und Prinzipien wie den Globalen Pakt der Vereinten Nationen, die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Bezug auf diese Normen und Prinzipien.

Des Weiteren schließt das Finanzprodukt Investitionen in Unternehmen aus, die direkt oder indirekt an den folgenden Geschäftstätigkeiten beteiligt sind: Umstrittene Waffen, Rüstungsaufträge, Kraftwerkskohle, Tabak, Ölsande, Schieferenergie, arktische Öl- und Gasexploration, Öl und Gas, Handfeuerwaffen, Erwachsenenunterhaltung, Alkohol, Glücksspiel, genetisch modifizierte Pflanzen und Saatgut, Atomwaffen, unlautere Kreditvergaben und Palmöl.

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

Das GSS überwacht die Beteiligung von Unternehmen an nennenswerten ESG-Kontroversen im Zusammenhang mit dem Betrieb des Unternehmens und/oder Produkten, mögliche Verstöße gegen internationale Normen und Prinzipien wie den Globalen Pakt der Vereinten

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.

Nationen, die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Bezug auf diese Normen und Prinzipien.

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 Kriterien der Union beigefügt.

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

Dieses Finanzprodukt wird passiv verwaltet und bildet einen Index nach. Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren werden vom Indexanbieter so berücksichtigt, wie es der Indexfamilie angemessen ist.

In den Indizes ist das Global Standards Screening (GSS) von Sustainalytics einbezogen, wodurch Emittenten zeitnah ausgefiltert werden, die gegen internationale Normen und Standards verstoßen. Den GSS-Beurteilungen liegen die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen zugrunde. GSS ist so konzipiert, dass es zeitnahe, einheitliche Einschätzungen zu ESG-Kontroversen liefert, an denen Emittenten beteiligt sind. An jedem Bezugsstermin für die Neugewichtung kommen gemäß Sustainalytics als nicht konform eingestufte Unternehmen nicht zur Indexaufnahme infrage. Nicht von Sustainalytics erfasste Unternehmen kommen, solange sie nicht entsprechend erfasst sind, ebenfalls nicht für eine Indexaufnahme infrage.

Das GSS überwacht die Beteiligung von Unternehmen an nennenswerten ESG-Kontroversen im Zusammenhang mit dem Betrieb des Unternehmens und/oder Produkten, mögliche Verstöße gegen internationale Normen und Prinzipien wie den Globalen Pakt der Vereinten Nationen, die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte sowie die Entwicklung im Hinblick auf diese Normen und Prinzipien.

Des Weiteren schließt das Finanzprodukt Investitionen in Unternehmen aus, die direkt oder indirekt an den folgenden Geschäftstätigkeiten beteiligt sind: Umstrittene Waffen, Rüstungsaufträge, Kraftwerkskohle, Tabak, Ölsande, Schieferenergie, arktische Öl- und

Gasexploration, Öl und Gas, Handfeuerwaffen, Erwachsenenunterhaltung, Alkohol, Glücksspiel, genetisch modifizierte Pflanzen und Saatgut, Atomwaffen, unlautere Kreditvergaben und Palmöl.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 31. Dezember 2025

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte*	Land
NVIDIA Corp.	Halbleiter	7,36	Vereinigte Staaten
Microsoft Corp.	Software	5,19	Vereinigte Staaten
Alphabet, Inc.	Internet	4,47	Vereinigte Staaten
Visa, Inc.	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	4,13	Vereinigte Staaten
Mastercard, Inc.	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	4,07	Vereinigte Staaten
Alphabet, Inc.	Internet	3,58	Vereinigte Staaten
AbbVie, Inc.	Pharmazeutika	3,51	Vereinigte Staaten
Bank of America Corp.	Banken	3,21	Vereinigte Staaten
Micron Technology, Inc.	Halbleiter	2,78	Vereinigte Staaten
Cisco Systems, Inc.	Telekommunikation	2,64	Vereinigte Staaten
Salesforce, Inc.	Software	2,19	Vereinigte Staaten
Abbott Laboratories	Gesundheitsprodukte	1,89	Vereinigte Staaten
Lam Research Corp.	Halbleiter	1,87	Vereinigte Staaten
Walt Disney Co.	Medien	1,77	Vereinigte Staaten
QUALCOMM, Inc.	Halbleiter	1,59	Vereinigte Staaten

**Aufgrund von Rundungs- und Bewertungsdifferenzen in den Produktionssystemen können geringfügige Unterschiede in der „Aufstellung des Wertpapierbestands“ auftreten.*



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in

Am Ende des Bezugszeitraums betrug der Anteil an Investitionen, die zur Erfüllung der durch das Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale herangezogen wurden, 99,85 %. Der Anteil an nachhaltigen Investitionen des Finanzprodukts lag bei 87,53 %.

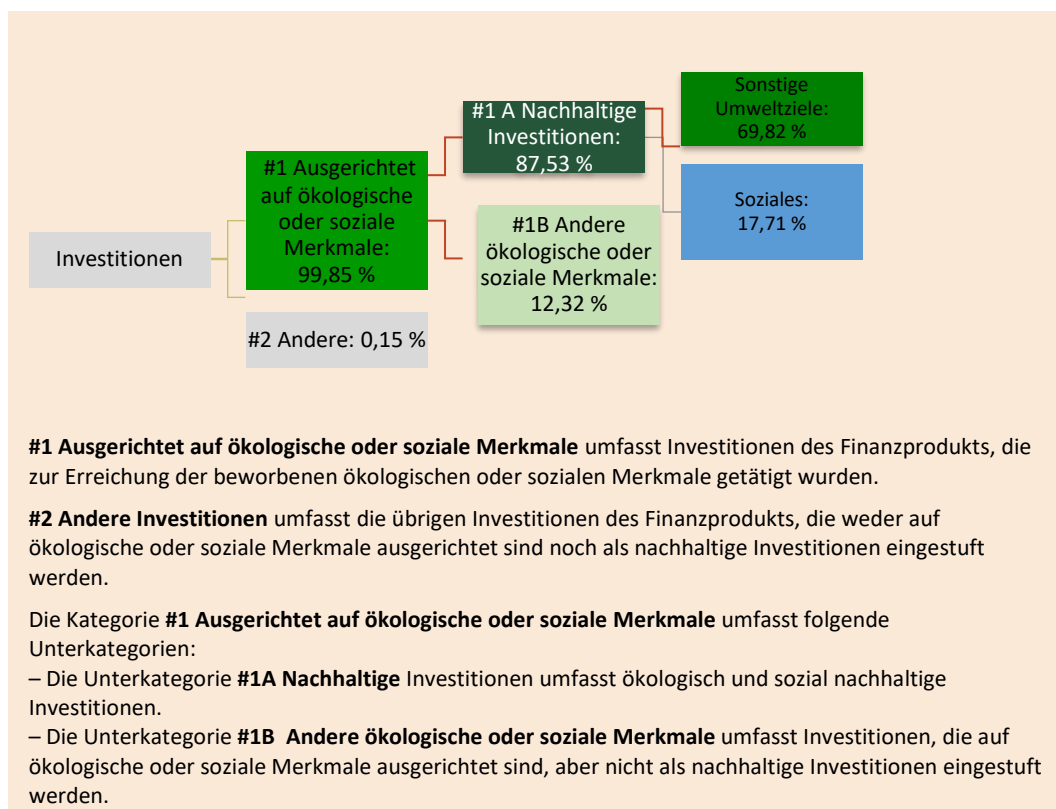
Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Anteile der Investitionen des Finanzprodukts wurden per Ende des Bezugszeitraums berechnet. Dabei handelt es sich um: 31. Dezember 2025

Zwecks Einhaltung der EU-Taxonomie umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionsbegrenzungen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energien oder CO₂-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** umfassen die Kriterien umfassende Regelungen im Bereich Sicherheits- und Abfallmanagement.

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 Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Eine Aufschlüsselung der Wirtschaftssektoren, in denen die Investitionen getätigt wurden, ist dem Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des jeweiligen Teilfonds in diesem Jahresbericht zu entnehmen.



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

Der Anteil taxonomiekonformer Investitionen an dem Finanzprodukt betrug 0 %.

Hat das Finanzprodukt in Wirtschaftstätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie investiert, die der EU-Taxonomie entsprechen¹²?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

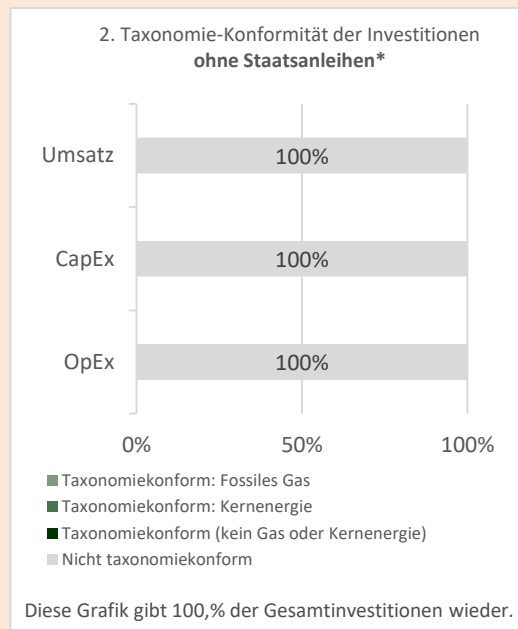
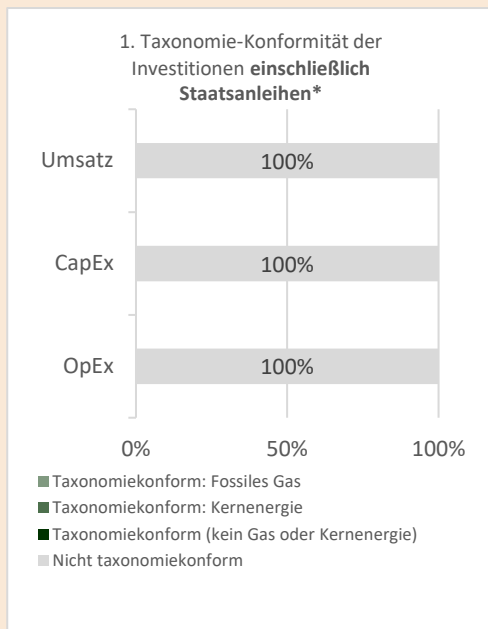
☒ Nein

¹² Wirtschaftstätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie entsprechen nur dann der EU-Taxonomie, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für Wirtschaftstätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die der EU-Taxonomie entsprechen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission aufgeführt.

Taxonomie-konforme Tätig-keiten, ausge-drückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Ein-nahmen aus umwelt-freundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitions-ausgaben (CapEx)**, die die umwelt-freundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umwelt-freundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

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



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

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

Es wurden keine Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten vorgenommen.

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Keine Veränderung. 0 % taxonomiekonforme Investitionen.



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

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, betrug 69,82 %.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 17,71 %

 sind nach-haltige Investitionen mit einem Umwelt-ziel, die **die Kriterien** für ökologisch nach-haltige Wirtschafts-tätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



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

Unter „#2 Andere Investitionen“ fallen Zahlungsmittel und Instrumente ohne Rating zu Liquiditätszwecken und zu Zwecken des Portfoliorisikomanagements. Instrumente ohne Rating können auch Wertpapiere umfassen, für die die zur Messung der Erreichung ökologischer oder sozialer Merkmale erforderlichen Daten nicht zur Verfügung stehen.



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

Die Ausrichtung der Anlagestrategie auf die Indexmethode war fortlaufend sichergestellt, da der Indexanbieter den Index regelmäßig neu gewichtet und der Anlageverwalter den Index in Übereinstimmung mit den in der Anlagepolitik des Fonds festgelegten Grenzen nachbildet.

Das Finanzprodukt hat den Referenzwert ursprünglich aufgrund seiner Bedeutung für seine Anlagestrategie und das Erreichen der Merkmale ausgewählt, die damit beworben werden sollten.

Die Anlagestrategie des Fonds bestand darin, die Rendite des Referenzwerts und dessen Merkmale so genau wie möglich nachzubilden, ESG-Merkmale eingeschlossen.

Die Anlagestrategie bestand darin, den Index vollständig nachzubilden und den Tracking Error zu minimieren. Der Anlageverwalter prüfte die Indexmethode, wenn das Produkt aufgelegt wurde. Wenn die Indexmethode nicht mehr der Anlagestrategie des Finanzprodukts entspricht, kann Kontakt mit dem Indexanbieter aufgenommen werden.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Der Referenzwert, der zum Erreichen der von dem Finanzprodukt beworbenen Merkmale bestimmt wurde, war S&P 500 ESG ELITE Index (Net Return).

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

Der Index bezieht seine Komponenten aus dem S&P 500 Index (der „übergeordnete Index“). Der Index wird wie folgt aufgebaut:

1. Beginnend mit dem übergeordneten Index wählen die Indizes aus allen Komponenten des zugrunde liegenden Index aus, ausgenommen einige Unternehmen, die als nicht infrage kommend gelten. Diese Unternehmen sind entweder:

- a. ohne ESG-Bewertung;
- b. in der Produktion und/oder dem Verkauf von Tabak tätig;
- c. im Geschäftsbereich umstrittene Waffen tätig;
- d. im unteren Segment einer Bewertung gemäß dem Globalen Pakt der Vereinten Nationen eingestuft, oder
- e. in den schlechtesten 25 % von Unternehmen innerhalb jeder globalen Branchengruppe gemäß ESG-Bewertung eingestuft.

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

2. Das Ziel ist 25 % der Marktkapitalisierung des ursprünglichen Index, wobei ESG-Bewertungen als bestimmendes Merkmal verwendet werden. Der endgültige Index ist marktkapitalisierungsgewichtet und sektorneutral gegenüber seinem übergeordneten Index (der S&P 500).

● **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?**

Basierend auf dem täglichen Durchschnittswert aus dem letzten Quartal des Geschäftsjahres entsprach die ESG-Bewertung (ESG-Score) der des Referenzwerts (S&P 500 ESG ELITE Index (Net Return)) (7,18 gegenüber 7,18).

Basierend auf dem täglichen Durchschnittswert aus dem letzten Quartal des Geschäftsjahres war eine kombinierte durchschnittliche Scope-1- und -2-CO₂-Intensität 0,05 % niedriger als die des Referenzwerts (S&P 500 ESG ELITE Index (Net Return)) (42,44 gegenüber 42,42).

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

Basierend auf dem täglichen Durchschnittswert aus dem letzten Quartal des Geschäftsjahres entsprach die ESG-Bewertung (ESG-Score) der des Referenzwerts (S&P 500 ESG ELITE Index (Net Return)) (7,18 gegenüber 7,18).

Basierend auf dem täglichen Durchschnittswert aus dem letzten Quartal des Geschäftsjahres war eine kombinierte durchschnittliche Scope-1- und -2-CO₂-Intensität 0,05 % niedriger als die des Referenzwerts (S&P 500 ESG ELITE Index (Net Return)) (42,44 gegenüber 42,42).

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

Basierend auf dem täglichen Durchschnittswert aus dem letzten Quartal des Geschäftsjahres war die ESG-Bewertung (ESG-Score) 14,70 % höher als die des übergeordneten Referenzwerts (S&P 500 Index) (7,18 gegenüber 6,26).

Basierend auf dem täglichen Durchschnittswert aus dem letzten Quartal des Geschäftsjahres war eine kombinierte durchschnittliche Scope-1- und -2-CO₂-Intensität 50,97 % niedriger als die des übergeordneten Referenzwerts (S&P 500 Index) (42,44 gegenüber 86,56).