
ESG-Kriterien

Fixed Income ESG Fonds

Letzte Aktualisierung: 14. März 2025

NUR ZUM PROFESSIONELLEN GEBRAUCH. NICHT GEGENÜBER PRIVATANLEGERN GÜLTIG.

SOFERN VON DIMENSIONAL IRELAND LIMITED HERAUSGEGEBEN: Herausgegeben von Dimensional Ireland Limited (Dimensional Ireland), mit Sitz in 3 Dublin Landings, North Wall Quay, Dublin 1, Irland. Dimensional Ireland wird von der Central Bank of Ireland (Registrierungsnummer C185067) beaufsichtigt. Dieses Dokument richtet sich ausschließlich an professionelle Kunden im Sinne der Richtlinie über Märkte für Finanzinstrumente (MiFID) (2014/65/EU).

SOFERN VON DIMENSIONAL FUND ADVISORS LTD. HERAUSGEGEBEN: Herausgegeben von Dimensional Fund Advisors Ltd. (Dimensional UK), Geschäftsanschrift 20 Triton Street, Regent's Place, London, NW1 3BF. Firmennummer 02569601. Dimensional UK ist zugelassen und beaufsichtigt von der britischen Finanzaufsichtsbehörde (Financial Conduct Authority, FCA) – Firmenreferenznummer 150100. Dieses Dokument richtet sich ausschließlich an Empfänger, die gemäß der Definition der FCA professioneller Kunde sind.

Dies ist eine Marketing-Anzeige. Bitte lesen Sie den Prospekt des OGAW, KID und das KIID, bevor Sie eine endgültige Anlageentscheidung treffen.

Die Informationen in diesem Dokument werden nach Treu und Glauben und ohne die Übernahme einer Garantie oder Gewähr der Richtigkeit und Vollständigkeit zur Verfügung gestellt; sie sind allein für den Gebrauch beim Empfänger und als Hintergrundinformation gedacht. In diesen Materialien dargestellte Informationen und Meinungen stammen aus von Dimensional Ireland und Dimensional UK, soweit zutreffend, (jeweils ein „Herausgebendes Unternehmen“, je nach Zusammenhang) als zuverlässig erachteten Quellen und das Herausgebende Unternehmen hat berechtigten Grund zu der Annahme, dass alle tatsächlichen Informationen in diesem Dokument zum Zeitpunkt der Erstellung des Dokuments korrekt sind. Es handelt sich nicht um eine Anlageberatung, Anlageempfehlung oder ein Angebot für Dienstleistungen oder Produkte zum Verkauf und ist nicht dazu bestimmt, eine hinreichende Grundlage für eine Investitionsentscheidung zu bieten. Es liegt in der Verantwortung jener Personen, die einen Kauf tätigen wollen, sich selbst zu informieren und alle anwendbaren Gesetze und Vorschriften zu beachten. Unberechtigtes Kopieren, Vervielfältigen, Duplizieren oder Übermitteln dieses Dokumentes ist strikt untersagt. Das Herausgebende Unternehmen übernimmt keine Haftung für Verluste, die sich aus der Verwendung der Informationen in diesem Dokument ergeben.

Emissionsdaten verstehen

Bei der Bewertung des CO₂-Fußabdrucks zählen sowohl vergangene als auch potenziell zukünftige Emissionen

Komponenten des CO₂-Fußabdrucks:



Begriffserklärung

Was sind Kohlendioxid-äquivalente (CO₂e)?

CO₂e ist eine Einheit zum Vergleich der Emissionen von sieben Treibhausgasen, für die jedes Gas auf der Grundlage seines Erwärmungspotenzials in eine entsprechende Menge CO₂ umgerechnet wird.¹

Was ist 1 Tonne CO₂e?



Äquivalent zu den Emissionen von **427** Litern Benzin¹



Äquivalent zum gebundenen Kohlenstoff von **1,2** Hektar US-Wäldern in einem Jahr¹

Was sind fossile Brennstoffreserven?

Manche Unternehmen besitzen Vermögenswerte wie Kohle-, Öl- und Gasreserven, die in Zukunft zu hohen Emissionen führen können.²

1. Quelle: EPA.gov.

2. Quelle: MSCI.

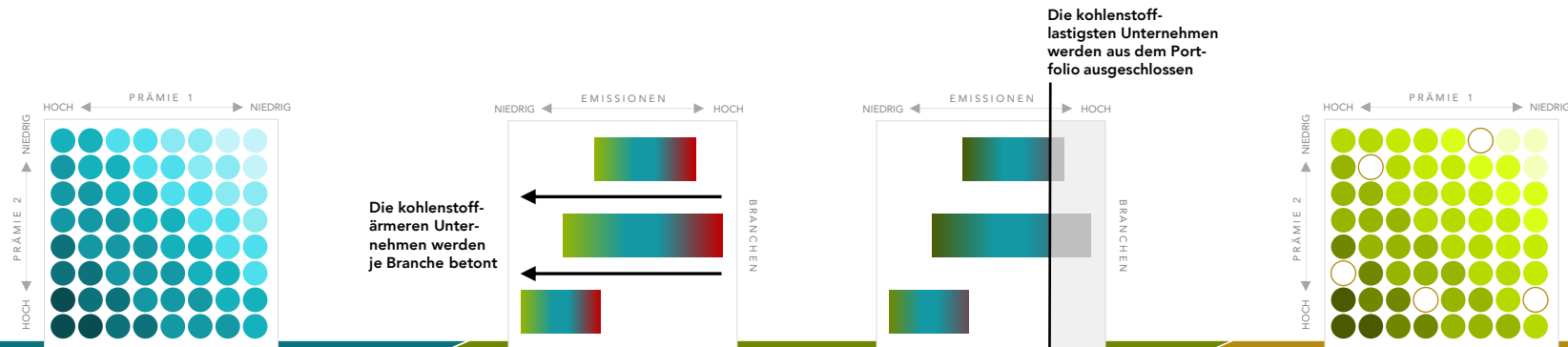
Kohlenstoffintensität basiert auf den aktuellsten ausgewiesenen oder geschätzten Scope 1 (direkten) und Scope 2 (indirekten) Treibhausgasemissionen eines Unternehmens in Kohlendioxidäquivalenten (CO₂e), normiert nach USD-Umsatz (metrische Tonnen CO₂e pro Mio. \$ Umsatz). Enthalte Treibhausgase sind: Kohlendioxid (CO₂), Methan (CH₄), Lachgas (N₂O), teilhalogenierte Fluorkohlenwasserstoffe (HFCs), perfluorierte Kohlenwasserstoffe (PFCs), Schwefelhexafluorid (SF₆) und Stickstofftrifluorid (NF₃). **Emissionspotenzial aus Reserven** basiert auf einer von MSCI bereitgestellten theoretischen Schätzung der Kohlendioxidemissionen eines Unternehmens, welches bei Umwandlung ausgewiesener Öl-, Gas und Kohlereserven in Energie entsteht (unter Berücksichtigung geschätzter Kohlenstoff- und Energiedichten).

Dimensionals ESG-Ansatz



Umsetzung der ESG-Kriterien

Fixed Income ESG Fonds



WAHRUNG SOLIDER ANLAGEPRINZIPIEN

Ausrichtung auf bewährte Prämien

- Beibehaltung einer dynamischen Durations-, Bonitäts- und Währungsallokation

Breite Diversifizierung

- Weiterhin hohe Titel- und Währungsabdeckung

Reduktion der Handelskosten

- Wahrung eines durchdachten Portfoliodesigns

BETONUNG KOHLENSTOFFÄRMERER UNTERNEHMEN¹

Übergewichtung der kohlenstoff-ärmeren Unternehmen je Branche



Betonung der branchenführenden Unternehmen



Untergewichtung der Branchennachzügler

Vermeidung der kohlenstoff-lastigsten Unternehmen im Markt



Ausschluss von Unternehmen mit der höchsten Kohlenstoffintensität



Ausschluss von Unternehmen mit dem höchsten Emissionspotenzial aus Reserven

ESG-AUSSCHLÜSSE¹

Nachteilige Geschäftstätigkeiten

- Umwelt: Kohle, Öl, Gas, Palmöl und Massentierhaltung
- Soziales: Erwachsenenunterhaltung, Alkohol, Glücksspiel, Tabak, private Gefängnisse, zivile Schusswaffen und kontroverse bzw. Atomwaffen

Nachteilige Geschäftspraktiken²

- z.B. Kontroversen im Zusammenhang mit der Umwelt, Kinderarbeit, Menschenrechte, Korruption und Betrug

Kohlenstoffärmere/-lastige Unternehmen sind Unternehmen mit niedrigen/hohen Kohlenstoffintensitäten und/oder Emissionspotenzialen aus Reserven. **Kohlenstoffintensität** basiert auf den aktuellsten ausgewiesenen oder geschätzten Scope 1 (direkten) und Scope 2 (indirekten) Treibhausgasemissionen eines Unternehmens in Kohlendioxidäquivalenten (CO₂e), normiert nach USD-Umsatz (metrische Tonnen CO₂e pro Mio. \$ Umsatz). Enthalte Treibhausgase sind: Kohlendioxid (CO₂), Methan (CH₄), Lachgas (N₂O), teilhalogenierte Fluorkohlenwasserstoffe (HFCs), perfluorierte Kohlenwasserstoffe (PFCs), Schwefelhexafluorid (SF₆) und Stickstofftrifluorid (NF₃). **Emissionspotenzial aus Reserven** basiert auf einer von MSCI bereitgestellten theoretischen Schätzung der Kohlendioxidemissionen eines Unternehmens, welches bei Umwandlung ausgewiesener Öl-, Gas und Kohlereserven in Energie entsteht (unter Berücksichtigung geschätzter Kohlenstoff- und Energiedichten). **Branchenführende Unternehmen** sind diejenigen mit der geringsten Kohlenstoffintensität innerhalb einer Branche. **Branchennachzügler** sind diejenigen mit der höchsten Kohlenstoffintensität innerhalb einer Branche. Siehe „Details zu ESG-Kriterien“ und „Erklärungen und Hinweise zu ESG-Daten“ für weitere Informationen.





1. Die ESG-Kriterien werden auf Unternehmensanleihen angewendet. Bestimmte Kriterien gelten auch für Nicht-Unternehmensanleihen. So werden Ausschlüsse aufgrund der Kohlenstoffintensität und des Emissionspotenzials aus Reserven auch auf supranationale Organisationen bzw. nichtstaatliche Agencies angewendet. Staats-/Kommunalanleihen werden zudem anhand der Treibhausgasemissionen pro BIP des jeweiligen Landes bewertet, wobei die mit den höchsten Emissionen (auf aggregierter Basis) untergewichtet werden.

2. Ausschluss von Unternehmen, bei denen das festgestellte Verhalten wegen wesentlicher Verwicklung in schwerwiegende Kontroversen nicht mit den Standards für verantwortungsvolles unternehmerisches Handeln übereinstimmt, die z. B. in den UN Global Compact-Grundsätzen und den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen festgelegt sind. Da in der Vergangenheit nur ein Bruchteil der Unternehmen in solche Kontroversen verwickelt war, hat dieser Ausschluss gegebenenfalls keine wesentliche Auswirkung auf das investierbare Universum eines Fonds.

Details zu ESG-Kriterien

Fixed Income ESG Fonds

BETONUNG KOHLENSTOFFÄRMERER UNTERNEHMEN¹

Ziel	Methodik	Richtlinie	Messung
Übergewichtung der kohlenstoffärmeren Unternehmen je Branche	 Allokation eines größeren Anteils seiner Investitionen in Unternehmensanleihen von Branchenführern, um „Best-in-Class“-Unternehmen hervorzuheben (gemessen anhand der Kohlenstoffintensität).	Der Fonds reduziert die gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität im Vergleich zum Markt ² um mindestens 50%.	Die gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität basiert auf der Kohlenstoffintensität (tCO ₂ e/Mio. USD Umsatz) eines Unternehmens sowie dessen Gewichtung im Fonds bzw. im Markt.
	 Allokation eines geringeren Anteils seiner Investitionen in Unternehmensanleihen von Branchennachzüglern (gemessen anhand der Kohlenstoffintensität).		
Vermeidung der kohlenstofflastigsten Unternehmen im Markt	 Ausschluss des Kaufs der Unternehmen mit der höchsten Kohlenstoffintensität.	Der Fonds reduziert das gewichtete durchschnittliche Emissionspotenzial aus Reserven im Vergleich zum Markt um mindestens 75%.	Das gewichtete durchschnittliche Emissionspotenzial aus Reserven basiert auf dem Emissionspotenzial aus Reserven (MtCO ₂) eines Unternehmens sowie dessen Gewichtung im Fonds bzw. im Markt.
	 Ausschluss des Kaufs der Unternehmen mit den größten fossilen Brennstoffreserven (gemessen anhand des Emissionspotenzials aus Reserven).		

Der Fonds strebt grundsätzlich Direktinvestitionen an und mindestens 80% seiner Investitionen werden auf die beworbenen E/S-Merkmale ausgerichtet sein. Siehe „Rechtliche Informationen“, um zu erfahren, wie Sie den Verkaufsprospekt des Fonds erhalten, der vollständige Informationen über die ESG-Kriterien des Fonds enthält. Außerdem verweisen wir auf die nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungen unter www.dimensional.com/SFDR.

1. Die ESG-Kriterien werden auf Unternehmensanleihen angewendet. Bestimmte Kriterien gelten auch für Nicht-Unternehmensanleihen. So werden Ausschlüsse aufgrund der Kohlenstoffintensität und des Emissionspotenzials aus Reserven auch auf supranationale Organisationen bzw. nichtstaatliche Agencies angewendet. Staats-/Kommunalanleihen werden zudem anhand der Treibhausgasemissionen pro BIP des jeweiligen Landes bewertet, wobei die mit den höchsten Emissionen (auf aggregierter Basis) untergewichtet werden.

2. Der Markt entspricht in etwa den Bestandteilen des Vergleichsindex, die zum Unternehmenssektor zugeordnet werden. Die Anleihen werden grundsätzlich nach ihrem Marktwert gewichtet.

Details zu ESG-Kriterien

ESG Fonds

ESG-AUSSCHLÜSSE ¹		
Bereich	Thema	Kriterium
Nachteilige Geschäftstätigkeiten: <i>Umwelt</i>	Kohle	Indizien für den Besitz von jeglichen nachgewiesenen und wahrscheinlichen thermischen oder metallurgischen Kohlereserven oder jegliche Umsätze aus der Exploration, dem Abbau, der Förderung, dem Vertrieb oder der Veredelung von Stein- und Braunkohle.
	Öl	10% oder mehr Umsatz aus der Exploration, der Förderung, dem Vertrieb oder der Veredelung von Erdöl.
	Gas	50% oder mehr Umsatz aus der Exploration, der Förderung, der Herstellung oder dem Vertrieb von gasförmigen Brennstoffen.
	Stromerzeugung aus fossilen Brennstoffen	50% oder mehr Umsatz aus der Stromerzeugung mit einer THG-Emissionsintensität von mehr als 100 g CO ₂ e/kWh (fossile Brennstoffe und Biomasse).
	Palmöl	10% oder mehr Umsatz aus Palmölanbau und/oder Palmölverarbeitung.
	Massentierhaltung	10% oder mehr Umsatz aus Branchen, die mit der Massentierhaltung zusammenhängen.
Nachteilige Geschäftstätigkeiten: <i>Soziales</i>	Erwachsenenunterhaltung	10% oder mehr Umsatz aus Produktion, Vertrieb oder Einzelhandel von Produkten der Erwachsenenunterhaltung.
	Alkohol	10% oder mehr Umsatz aus Produktion, Vertrieb, Einzelhandel, Lizenzierung oder Lieferung von alkoholischen Getränken, Schlüsselprodukten und Dienstleistungen.
	Glücksspiel	10% oder mehr Umsatz aus Besitz oder Betrieb von Glücksspieleinrichtungen oder aus der Unterstützung oder Dienstleistungen für die Glücksspielindustrie.
	Tabak	Jegliche Verwicklung in den Anbau und die Produktion von Tabak oder 10% oder mehr Umsatz aus Vertrieb, Einzelhandel, Lizenzierung oder Lieferung der wichtigsten Tabakprodukte und -dienstleistungen.
	Private Gefängnisse	Besitz oder jegliche Umsätze aus Betrieb von privaten Gefängnissen und/oder Haftanstalten für Einwanderer.
	Zivile Schusswaffen	Jegliche Umsätze aus Produktion von Handfeuerwaffen, Pistolen, Schrotflinten, Gewehren, Revolvern und Munition für zivile (nicht-militärische) Zwecke.
Nachteilige Geschäftspraktiken	Kontroverse bzw. Atomwaffen	Jegliche Verwicklung in die Herstellung von Streumunition oder Antipersonenminen oder deren Schlüsselkomponenten, chemischen und biologischen Waffen, Munition und Panzerung mit abgereicherem Uran oder Atomwaffen oder deren Schlüsselkomponenten.
	ESG-Kontroversen	Wesentliche Verwicklung in schwerwiegende Kontroversen in Zusammenhang mit der Umwelt (z. B. Landnutzung und Biodiversität, Freisetzung von Schadstoffen, Betriebsabfälle oder Wassermanagement), Gesellschaft (z. B. Kinderarbeit oder Menschenrechte) oder Unternehmensführung (z. B. Korruption oder Betrug).

1. Dimensionals ESG Fonds haben grundsätzlich das Ziel, (a) den Kauf von Unternehmen zu vermeiden und (b) Unternehmen zu veräußern, die unserer Meinung nach in diese Tätigkeiten und Kontroversen verwickelt sind. Indirekte Verwicklungen, z.B. durch Eigentümerstrukturen, können ebenfalls zum Ausschluss führen. Sollten vorhandene Bestände, die zum Zeitpunkt des Kaufs konform waren, später von diesen Ausschlusskriterien betroffen sein, werden sie unter Berücksichtigung des Kapitalumschlags, der Liquidität und der damit verbundenen Handelskosten innerhalb eines angemessenen Zeitraums veräußert. Ausschlüsse gelten nicht für Barmittel, Derivate oder Fondsbestände von Drittanbietern. Wenn sich weder aus internen noch aus externen Quellen relevante Informationen gewinnen lassen, die zum Ausschluss eines Unternehmens aus dem Fonds führen würden, gilt das Unternehmen als zulässig für eine Investition.

Anhang

Rechtliche Informationen

NUR ZUM PROFESSIONELLEN GEBRAUCH. NICHT GEGENÜBER PRIVATANLEGERN GÜLTIG.

Die Informationen in diesem Material sind allein für den Gebrauch beim Empfänger und als Hintergrundinformation gedacht. Sie werden nach Treu und Glauben und ohne die Übernahme einer Garantie oder Gewähr der Richtigkeit und Vollständigkeit zur Verfügung gestellt. In diesem Material dargestellte Informationen und Meinungen stammen aus von Dimensional als zuverlässig erachteten Quellen und Dimensional hat berechtigten Grund zu der Annahme, dass alle tatsächlichen Informationen in diesem Material zum Zeitpunkt der Erstellung des Materials korrekt sind. Es handelt sich nicht um eine Anlageberatung, Anlageempfehlung oder ein Angebot für Dienstleistungen oder Produkte zum Verkauf und ist nicht dazu bestimmt, eine hinreichende Grundlage für eine Investitionsentscheidung zu bieten. Bevor Sie aufgrund der in diesem Material enthaltenen Informationen handeln, sollten Sie prüfen, ob diese unter Beachtung der besonderen Umstände ihres Falls angemessen sind, und gegebenenfalls professionellen Rat einholen. Es liegt in der Verantwortung jener Personen, die einen Kauf tätigen wollen, sich selbst zu informieren und alle anwendbaren Gesetze und Vorschriften zu beachten. Unberechtigtes Vervielfältigen oder Übermitteln dieses Materials ist strikt untersagt. Dimensional übernimmt keine Haftung für Verluste, die sich aus der Verwendung der Informationen in diesem Material ergeben.

Dieses Material ist nicht an Personen in Ländern gerichtet, in denen die Bereitstellung dieses Materials verboten ist oder Dimensional oder seine Produkte oder Dienstleistungen Registrierungs-, Lizenzierungs- oder anderen gesetzlichen Verpflichtungen in dem jeweiligen Land unterwerfen würde.

„Dimensional“ bezieht sich auf die Gesellschaften aus der Dimensional-Unternehmensgruppe im Allgemeinen und nicht auf eine bestimmte Gesellschaft. Zu den Gesellschaften gehören Dimensional Fund Advisors LP, Dimensional Fund Advisors Ltd., Dimensional Ireland Limited, DFA Australia Limited, Dimensional Fund Advisors Canada ULC, Dimensional Fund Advisors Pte. Ltd., Dimensional Japan Ltd. und Dimensional Hong Kong Limited. Dimensional Hong Kong Limited ist zugelassen von der Securities and Futures Commission und berechtigt, ausschließlich regulierte Aktivitäten des Typ 1 (Handel mit Wertpapieren) zu betreiben; Vermögensverwaltungsdienstleistungen werden nicht angeboten.

SOFERN VON DIMENSIONAL IRELAND LIMITED HERAUSGEGEBEN

Herausgegeben von Dimensional Ireland Limited (Dimensional Ireland), mit Sitz in 3 Dublin Landings, North Wall Quay, Dublin 1, Irland. Dimensional Ireland wird von der Central Bank of Ireland (Registrierungsnummer C185067) beaufsichtigt.

Ausschließlich gerichtet an professionelle Kunden im Sinne der Richtlinie über Märkte für Finanzinstrumente (MiFID) (2014/65/EU).

SOFERN VON DIMENSIONAL FUND ADVISORS LTD. HERAUSGEGEBEN

Herausgegeben von Dimensional Fund Advisors Ltd. (Dimensional UK), Geschäftsanschrift 20 Triton Street, Regent's Place, London, NW1 3BF. Dimensional UK ist zugelassen und beaufsichtigt von der britischen Finanzaufsichtsbehörde (Financial Conduct Authority, FCA) – Firmenreferenznummer 150100.

Ausschließlich gerichtet an Empfänger, die gemäß der Definition der FCA professioneller Kunde sind.

Dimensional UK und Dimensional Ireland geben Informationen und Materialien auf Englisch heraus und können die Informationen und Materialien zusätzlich auch in anderen Sprachen herausgeben. Die fortlaufende Akzeptanz von Informationen und Materialien von Dimensional UK und Dimensional Ireland durch den Empfänger gilt als Zustimmung des Empfängers, dass ihm diese Informationen und Materialien, gegebenenfalls in mehr als einer Sprache, zur Verfügung gestellt werden.

Wertentwicklungsinformationen werden durch Dimensional mit Stand des Datums dieses Materials bereitgestellt, sofern nicht anders angegeben. Aktuelle Wertentwicklungsdaten zum letzten Monatsende finden Sie auf unserer Webseite dimensional.com. Durchschnittliche Gesamtjahresrenditen beinhalten die Wiederanlage von Dividenden und Kapitalerträgen.

Dies ist eine Marketing-Anzeige. Bitte lesen Sie den Prospekt des OGAW, KID und das KIID, bevor Sie eine endgültige Anlageentscheidung treffen.

DIMENSIONAL FUNDS PLC:

Der Emerging Markets Large Cap Core Equity Fund, Emerging Markets Value Fund, Euro Inflation Linked Intermediate Duration Fixed Income Fund, European Small Companies Fund, European Value Fund, Global Core Equity Fund, Global Core Fixed Income Fund, Global Short Fixed Income Fund, Global Short-Term Investment Grade Fixed Income Fund, Global Small Companies Fund, Emerging Markets Core Equity Lower

Carbon ESG Screened Fund, Global Core Equity Lower Carbon ESG Screened Fund, Global Core Fixed Income Lower Carbon ESG Screened Fund, Global Short Fixed Income Lower Carbon ESG Screened Fund, Global High Profitability Lower Carbon ESG Screened Fund, Global Targeted Value Lower Carbon ESG Screened Fund, World Equity Lower Carbon ESG Screened Fund (die Implementierung und Verwaltung des Emerging Markets Core Equity Lower Carbon ESG Screened Fund, Global Core Equity Lower Carbon ESG Screened Fund, Global Core Fixed Income Lower Carbon ESG Screened Fund, Global Short Fixed Income Lower Carbon ESG Screened Fund, Global High Profitability Lower Carbon ESG Screened Fund, Global Targeted Value Lower Carbon ESG Screened Fund und World Equity Lower Carbon ESG Screened Fund ist durch die US-amerikanischen Patentnummern 7,596,525 B1, 7,599,874 B1 und 8,438,092 B2 geschützt), Global Targeted Value Fund, Global Ultra Short Fixed Income Fund, Global Value Fund, Pacific Basin Small Companies Fund, Sterling Inflation Linked Intermediate Duration Fixed Income Fund, U.S. Core Equity Fund, U.S. Small Companies Fund, World Allocation 20/80 Fund, World Allocation 40/60 Fund, World Allocation 60/40 Fund, World Allocation 80/20 Fund und der World Equity Fund sind Teilfonds von Dimensional Funds plc, der als Dachfonds mit einer getrennten Haftung für die einzelnen Teilfonds errichtet worden ist. Er wurde als eine offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital nach irischem Recht gegründet und ist registriert unter der Registernummer 352043. Dimensional Funds plc ist als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) von der Central Bank of Ireland zugelassen.

DIMENSIONAL FUNDS II PLC:

Der Emerging Markets Targeted Value Fund ist ein Teilfonds von Dimensional Funds II plc (die „Dimensional Fonds“), der als Dachfonds mit einer getrennten Haftung für die einzelnen Teilfonds errichtet worden ist. Er wurde als eine offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital nach irischem Recht gegründet und ist registriert unter der Registernummer 431052. Dimensional Funds II plc ist als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) von der Central Bank of Ireland zugelassen.

DIMENSIONAL FUNDS ICVC:

Der United Kingdom Core Equity Fund, United Kingdom Value Fund, United Kingdom Small Companies Fund, International Core Equity Fund, International Value Fund, Emerging Markets Core Equity Fund, Sterling Short Duration Real Return Fund und der Global Short Dated Bond Fund sind Teilfonds von Dimensional Funds ICVC (die „Dimensional Fonds“), einer Investmentgesellschaft mit variablem Kapital und beschränkter Haftung, die in England und Wales unter der Nummer IC000258 registriert und von der FCA als UK-OGAW zugelassen ist. Dimensional UK ist der bevollmächtigte Direktor (Authorised Corporate Director, ACD) von Dimensional Funds ICVC. Die Teilfonds laufen getrennt voneinander und die Vermögenswerte eines jeden Teilfonds werden im Einklang mit dem Anlageziel und der Anlagepolitik eines jeden Teilfonds verwaltet.

Dimensional Funds ICVC (die „UK Fonds“), Dimensional Funds plc und Dimensional Funds II plc (die „irischen Fonds“) (zusammen die „Dimensional Fonds“) werden ausschließlich gemäß den Bedingungen des jeweiligen aktuellen Verkaufsprospektes und der entsprechenden wesentlichen UCITS Anlegerinformation (Key Investor Information Document, KIID) und des entsprechenden Basisinformationsblattes (Key Information Document, KID) nach der PRIIPs-Verordnung (Packaged Retail and Insurance-Based Investment Products – PRIIPs) angeboten. Vor einem Investment empfehlen wir Ihnen, sich ausführlich mit den Zielen, Risiken, Gebühren und Kosten der Dimensional Fonds zu befassen. Für diese und weitere Informationen über Dimensional Fonds lesen Sie bitte den Prospekt, KID und KIID sorgfältig durch, bevor Sie ein Investment tätigen. Die aktuellste Version des Prospekts, des entsprechenden UCITS KIID (in Englisch erhältlich) und entsprechenden PRIIPs KID (in Englisch und der jeweiligen Landessprache erhältlich) für die UK Fonds erhalten Sie unter dimensional.com oder indem Sie den Administrator bzw. Investmentmanager des Fonds unter +44 (0)20 3033 3300 kontaktieren. Die aktuellste Version des Prospekts, des entsprechenden UCITS KIID (in Englisch erhältlich) und entsprechenden PRIIPs KID (in Englisch und der jeweiligen Landessprache erhältlich) für die irischen Fonds erhalten Sie unter www.dimensional.com oder indem Sie den Administrator des Fonds unter +353 1 242 5536, dessen Vertriebsstelle Dimensional Ireland Limited unter +353 1 576 9750 oder, im Vereinigten Königreich, dessen Untervertriebsstelle Dimensional Fund Advisors Ltd. unter +44 (0)20 3033 3300 kontaktieren.

Darüber hinaus steht eine Zusammenfassung der Anlegerrechte unter www.dimensional.com/ssr zur Verfügung. Die Zusammenfassung ist in englischer Sprache verfügbar.

Dimensional Funds plc und Dimensional Funds II plc haben derzeit den Vertrieb in einer Reihe von EU-Mitgliedstaaten gemäß der OGAW-Richtlinie angezeigt. Dimensional Funds plc und Dimensional Funds II plc können diese Anzeige für jeden Dimensional Fonds jederzeit nach dem in Artikel 93a der OGAW-Richtlinie vorgesehenen Verfahren widerrufen.

Rechtliche Informationen

RISIKEN

Kapitalanlagen beinhalten Risiken. Der angelegte Kapitalwert sowie die daraus erzielte Kapitalrendite unterliegen Schwankungen, sodass der Wert der Anteile eines Investors bei Rückgabe über oder unter dem Erwerbkurs liegen kann. Es gibt keine Garantie dafür, dass Strategien erfolgreich sein werden.

Die angegebenen Wertentwicklungsdaten zeigen die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind keine Garantie für die zukünftige Wertentwicklung. Die aktuelle Wertentwicklung kann über oder unter der angegebenen Wertentwicklung liegen. Renditen können aufgrund von Währungsschwankungen steigen oder fallen.

Die Hauptrisiken bei einer Investition in einen Dimensional Fonds können aus einem oder mehreren der folgenden Risiken bestehen: Marktrisiko, Risiko von Kleinunternehmen, Konzentrationsrisiko im Immobiliensektor, das mit ausländischen Wertpapieren und Währungen verbundene Risiko, Liquiditätsrisiko, politisches Risiko, Steuerrisiko, Abwicklungsrisiko, das mit der Verfügbarkeit von Marktinformationen verbundene Risiko, Schwellenländerrisiko, Konzentrationsrisiken im Bankensektor, Zinsänderungsrisiko, Risiko der Anlage zum Inflationsschutz, Risiko aus Anleihen und/oder Dachfondsrisiko. Um die mit einer Fondsanlage verbundenen Risiken vollständig zu verstehen, sollten Anleger den Verkaufsprospekt jedes Fonds und die entsprechenden KIIDs und KIDs aufmerksam lesen.

Festverzinsliche Wertpapiere unterliegen in Perioden steigender Zinssätze erhöhten Kapitalverlusten und können zahlreichen weiteren Risiken, einschließlich Änderungen der Kreditqualität, der Liquidität, von Vorauszahlungen oder anderen Faktoren, unterliegen. Wertpapiere aus dem Small-Cap-Segment unterliegen einer größeren Volatilität als solche in anderen Wertkategorien. Überprüfungen von Umwelt- und Sozialaspekten können Anlagemöglichkeiten für den Fonds einschränken. Internationale Anlagen beinhalten spezielle Risiken wie beispielsweise Währungsschwankungen und politische Instabilitäten. Anlagen in Wachstumsmärkten können diese Risiken verstärken. Sektorenspezifische Anlagen können Anlagerisiken ebenfalls erhöhen.

Erklärungen und Hinweise zu ESG-Daten

Angaben zu den Datenanbietern

Bestimmte Informationen, die hierin enthalten sind, wurden von Institutional Shareholder Services Inc. („ISS“) und von MSCI ESG Research Inc. („MSCI“) zur Verfügung gestellt. Obwohl die von Dimensional Fund Advisors genutzten Informationsanbieter, insbesondere ISS und MSCI und deren verbundenen Unternehmen (die „Datenanbieter“), Informationen aus Quellen beziehen, die sie für zuverlässig halten, übernimmt keiner der Datenanbieter eine Garantie für die Echtheit, Richtigkeit und/oder Vollständigkeit der hierin enthaltenen Daten. Die Datenanbieter übernehmen weder ausdrückliche noch stillschweigende Garantien und lehnen hiermit ausdrücklich jegliche Garantien zur Marktgängigkeit und Eignung der hierin enthaltenen Daten für einen bestimmten Zweck ab. Die Datenanbieter haften nicht für etwaige Fehler oder Versäumnisse in Verbindung mit den hierin enthaltenen Daten. Ohne das Vorstehende einzuschränken, übernimmt keiner der Datenanbieter eine Haftung für direkte, indirekte, besondere, straf- oder bußgeldbewährte sowie sonstige Schäden oder Folgeschäden (einschließlich entgangener Gewinne), selbst wenn sie über die Möglichkeit solcher Schäden informiert wurde.

Datenquellen und Einschränkungen

Die folgenden Datenquellen werden verwendet, um die ESG-Kriterien der Dimensional ESG-Fonds umzusetzen:

- Die Daten für die Kohlenstoffintensität stammen von externen Anbietern wie MSCI und ISS.
- Die Daten für das Emissionspotenzial aus Reserven stammen in erster Linie von externen Anbietern wie MSCI und können durch interne Datensätze ergänzt werden.
- Die Daten zu den Treibhausgasemissionen pro BIP auf staatlicher Ebene stammen aus externen Quellen wie Climate Watch und der Weltbank.
- Die Daten für die Geschäftstätigkeiten stammen in erster Linie von externen Anbietern wie MSCI und ISS und können durch interne Datensätze ergänzt werden.
- Die Daten für die ESG-Kontroversen stammen in erster Linie von externen Anbietern wie MSCI und ISS und können durch interne Datensätze und/oder Informationen aus öffentlich verfügbaren Bewertungen ergänzt werden.

Das Universum ökologischer und sozialer Daten ist noch jung, mangelnde Unternehmensdaten sind weiterhin eine der größten Einschränkungen. Zum Beispiel weisen kleinere Unternehmen sowie Unternehmen aus Schwellenmärkten tendenziell seltener Treibhausgasemission aus, wobei sich das Volumen ausgewiesener Daten in diesen Märkten kontinuierlich verbessert. Eine weitere Einschränkung ist die Inkonsistenz der Daten und Methoden zwischen verschiedenen Anbietern und Unternehmen. Dimensional verlässt sich nicht auf ESG-Ratings von Drittanbietern, da diese oft subjektiv sind, und konzentriert sich stattdessen auf objektivere und konsistentere ausgewiesene Kennzahlen. Wir unternehmen wirtschaftlich angemessene Anstrengungen in der Sammlung externer und Entwicklung interner Datensätze, damit die Dimensional ESG-Fonds in der Lage sind, die ESG-Kriterien umzusetzen.

Bei Aktien liefern externe Anbieter beispielsweise gemeldete oder modellierte Daten zur Kohlenstoffintensität für fast alle Unternehmen (gemessen an der Streubesitz-Marktkapitalisierung), die für die Dimensional ESG-Fonds in Frage kommen. Bei Unternehmen, für die keine Daten zur Kohlenstoffintensität verfügbar sind, wird ein Branchendurchschnitt verwendet. Bei Unternehmen, für die keine Daten zum Emissionspotenzial aus Reserven, weder aus externen noch aus internen Datensätzen, verfügbar sind, werden Emissionen von Null verwendet.

Bei Anleihen liefern externe Anbieter beispielsweise gemeldete oder modellierte Daten zur Kohlenstoffintensität für fast alle Unternehmen (gemessen am Marktwert der ausstehenden Anleihen), die für die Dimensional ESG-Fonds in Frage kommen. Bei Unternehmensemittenten, für die keine Daten zur Kohlenstoffintensität verfügbar sind, wird ein Branchendurchschnitt verwendet. Agency-/supranationale Emittenten, für die keine Daten zur Kohlenstoffintensität verfügbar sind, werden bei der Berechnung nicht berücksichtigt, da keine zuverlässige Schätzung möglich ist (Informationen zur Datenverfügbarkeit von Agency-/supranationalen Emittenten werden im Jahresbericht der Dimensional ESG-Fonds offengelegt). Bei Emittenten, für die keine Daten zum Emissionspotenzial aus Reserven, weder aus externen noch aus internen Datensätzen, verfügbar sind, werden Emissionen von Null verwendet. Staatliche und kommunale Emittenten, für die keine Daten zu den Treibhausgasemissionen pro BIP auf staatlicher Ebene verfügbar sind, werden zu den höchsten Emittenten gezählt.

EU: Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten

Der Emerging Markets Core Equity Lower Carbon ESG Screened Fund, Global Core Equity Lower Carbon ESG Screened Fund, Global Core Fixed Income Lower Carbon ESG Screened Fund, Global Short Fixed Income Lower Carbon ESG Screened Fund, Global High Profitability Lower Carbon ESG Screened Fund, Global Targeted Value Lower Carbon ESG Screened Fund und World Equity Lower Carbon ESG Screened Fund (die „ESG-Fonds“) bewerben Nachhaltigkeit in Übereinstimmung mit Artikel 8 der Verordnung (EU 2019/2088) über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (SFDR). Die ESG-Fonds haben nachhaltige Investitionen zwar nicht als Anlageziel, aber der Investmentmanager wird Nachhaltigkeitsauswirkungen, die mit Wertpapieren verbunden sind, als Bestandteil der Anlagepolitik bei Anlageentscheidungen für die ESG-Fonds berücksichtigen.

Obwohl die ESG-Fonds Nachhaltigkeit bewerben und der Investmentmanager Nachhaltigkeitsauswirkungen berücksichtigt, werden die Anlagen der ESG-Fonds nicht anhand der EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten bewertet, so dass der Grundsatz „keinen erheblichen Schaden verursachen“ für die Anlagen der ESG-Fonds nicht gilt. Prüfen Sie die Anlageziele der Dimensional Fonds sorgfältig, bevor Sie investieren. Für diese und weitere Informationen über die Dimensional Fonds lesen Sie bitte die jeweiligen Verkaufsprospekte, KID und KIID sorgfältig durch, bevor Sie investieren. Informationen über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (SFDR) gemäß der Verordnung (EU) 2019/2088 in Bezug auf den beworbenen Fonds finden Sie unter: www.dimensional.com/SFDR.

Verweise auf „nachhaltig“ oder „Nachhaltigkeit“ in diesem Material bedeuten nicht, dass die ESG-Fonds sich zu nachhaltigen Investitionen im Sinne der nachhaltigkeitsbezogenen Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (SFDR) verpflichten. Die ESG-Fonds können ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, verpflichten sich jedoch nicht zu nachhaltigen Investitionen.