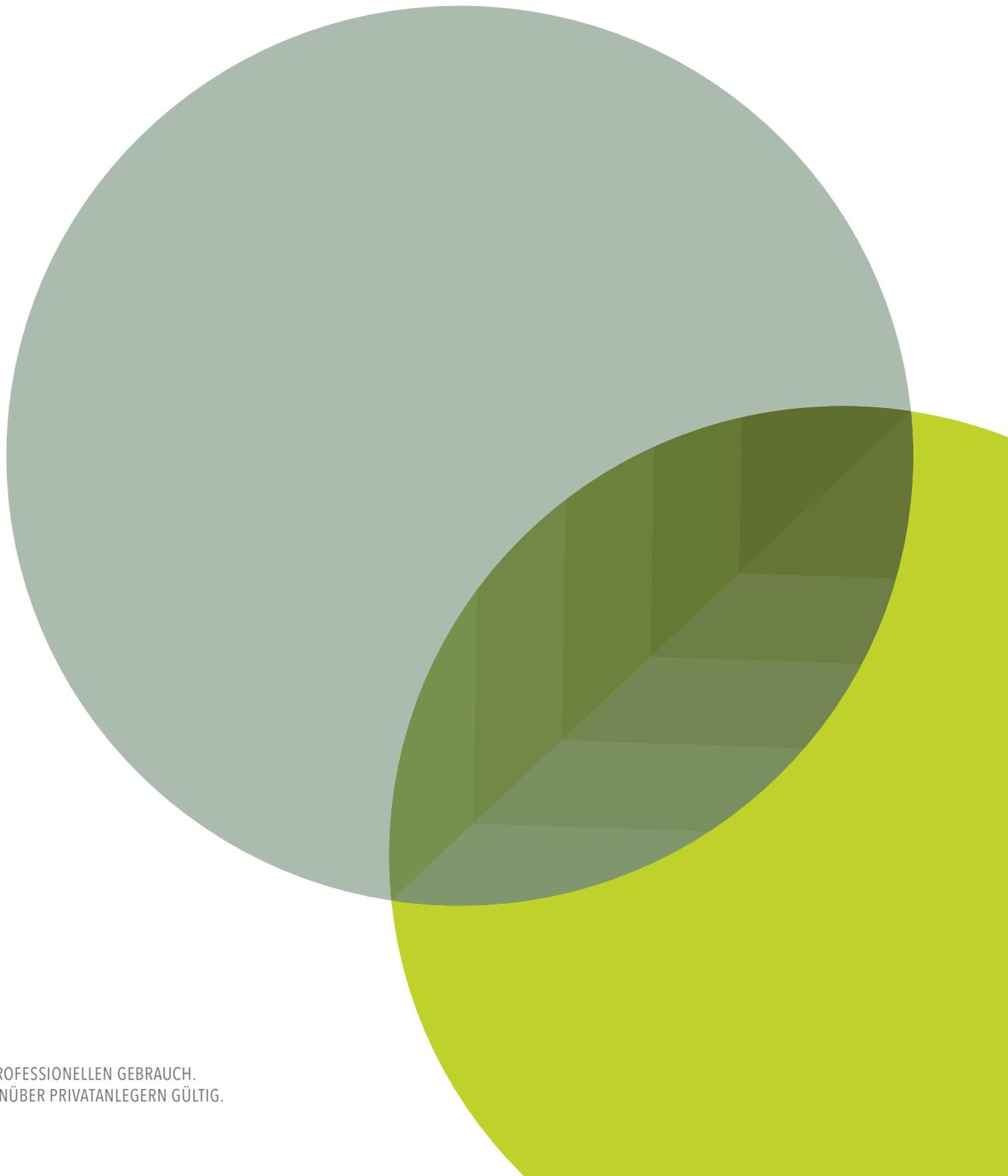




NACHHALTIGKEITSFONDS



Wissenschaftlich fundierte Nachhaltigkeitsstrategien

Viele Anleger wollen ihre ökologischen Überzeugungen auch durch ihr Portfolio zum Ausdruck bringen. Aber können sie diese Werte verwirklichen und gleichzeitig solide Anlagegrundsätze beibehalten und höhere erwartete Renditen verfolgen?

Mit den patentgeschützten Nachhaltigkeitsstrategien von Dimensional können Anleger ökologische und andere Nachhaltigkeitskriterien im Rahmen eines robusten Anlageprozesses umsetzen. Unsere Nachhaltigkeitsstrategien sind durch unsere enge Zusammenarbeit mit führenden Wissenschaftlern und unsere langjährige Erfahrung in der Integration von Daten in unsere Anlageprozesse entstanden. In ihnen streben wir sowohl messbare Nachhaltigkeitsziele als auch breite Diversifikation, Kosteneffizienz und höhere erwartete Renditen an.

NACHHALTIGKEITSKRITERIEN¹

Unser patentierter Anlageprozess erfasst wissenschaftlich fundierte Nachhaltigkeitskriterien, die wir durch Ausschluss und/oder Gewichtungsanpassungen umsetzen. Dadurch bilden Unternehmen mit besserem Nachhaltigkeitsprofil den Schwerpunkt unserer Portfolios.

Emissionskriterien ²	Sonstige ökologische und soziale Kriterien		
<ul style="list-style-type: none">• Treibhausgasemissionsintensität• Emissionspotenzial aus Reserven	<ul style="list-style-type: none">• Landnutzung und Biodiversität• Freisetzung von Schadstoffen• Betriebsabfälle• Wassermanagement	<ul style="list-style-type: none">• Kohle• Palmöl• Massentierhaltung• Erwachsenenunterhaltung• Alkohol	<ul style="list-style-type: none">• Glücksspiel• Tabak• Zivile Schusswaffen• Kontroverse Waffen• Atomwaffen• Kinderarbeit

1. Die Nachhaltigkeitskriterien einzelner Fonds können voneinander abweichen. Weitere Informationen finden Sie im Prospekt des jeweiligen Fonds. Die Nachhaltigkeitsbewertungen beruhen auf Kriterien, die von Dimensional definiert wurden. Die Gewichtung der Unternehmen in den einzelnen Nachhaltigkeitskategorien (z. B. „Am nachhaltigsten“, „überdurchschnittlich“, „durchschnittlich“, „unterdurchschnittlich“ und „Am wenigsten nachhaltig“) wird auf Grundlage der Berechnung von Breakpoints anhand der Nachhaltigkeitskennzahl der Unternehmen innerhalb ihres jeweiligen Zielmarktes ermittelt.

2. Die Intensität der Treibhausgasemissionen entspricht den aktuellsten ausgewiesenen oder geschätzten direkten (Scope 1) und indirekten (Scope 2) Treibhausgasemissionen des jeweiligen Unternehmens in Kohlendioxid-Äquivalenten (CO₂e). Die Angaben wurden nach Umsatz in EUR normiert (metrische Tonnen CO₂e pro Mio. EUR Umsatz). In den Daten enthalten sind die sieben im Kyoto-Protokoll erfassten Treibhausgase: Kohlenstoffdioxid (CO₂), Methan (CH₄), Lachgas (N₂O), teilhalogenierte Fluorkohlenwasserstoffe (HFCs), perfluorierte Kohlenwasserstoffe (PFCs), Schwefelhexafluorid (SF₆) und Stickstofftrifluorid (NF₃). Das Emissionspotenzial aus Reserven entspricht einer theoretischen Schätzung des Kohlenstoffdioxidausstoßes, der bei der Umwandlung der ausgewiesenen Öl-, Gas- und Kohlereserven eines Unternehmens in Energie entsteht. Bei der Berechnung wird die geschätzte Kohlenstoff- und Energiedichte der jeweiligen Reserven berücksichtigt. Beide Methoden können sich durch Datenentwicklungen oder andere Befunde bzw. Ereignisse ändern. Weitere Informationen zur Emissions-Belastung der Dimensional Nachhaltigkeitsfonds finden Sie unter eu.dimensions.com. Quelle: Greenhouse Gas Equivalencies Calculator, US Environmental Protection Agency (EPA). Definitionen der CO₂-Äquivalenzen sind abrufbar unter: epa.gov/energy/greenhouse-gases-equivalencies-calculator-calculations-and-references.

GLOBALE ANLAGESTRATEGIEN

Dimensional bietet Nachhaltigkeitslösungen für Aktien- und Anleihenmärkte an, mit denen Anleger ihr global diversifiziertes Portfolio anpassen und gleichzeitig konsequent auf Nachhaltigkeit ausrichten können.

Global Sustainability Core Equity Fund

Global Sustainability Fixed Income Fund

Emerging Markets Sustainability Core Equity Fund

Anlagelösungen, die auf Umweltwissenschaft basieren

Dimensional arbeitet mit führenden Klimawissenschaftlern zusammen, um die aktuelle Forschung zu verstehen. Den Schwerpunkt unserer Nachhaltigkeitsphilosophie bilden die wichtigsten Treiber des Klimawandels: Treibhausgasemissionen und fossile Brennstoffreserven, die zukünftige Emissionen ermöglichen. Basierend auf diversen Forschungsergebnissen adressieren unsere Nachhaltigkeitslösungen diese und weitere Nachhaltigkeitsvariablen.

Ausrichtung auf höhere erwartete Renditen

Unsere Strategien verbinden Nachhaltigkeitsziele mit einer breiten Diversifikation und gewichten Aktien und Anleihen

mit höheren erwarteten Renditen systematisch über. Wir wenden diesen Ansatz sowohl für Aktien- als auch für Anleihenlösungen an. Indem wir uns genau mit den Ergebnissen der Umweltforschung auseinandersetzen und Zielkonflikte abwägen, können wir das Nachhaltigkeitsprofil unserer Fonds verbessern und gleichzeitig höhere erwartete Renditen anstreben.

Ausrichtung auf messbare Nachhaltigkeitsziele

Wir streben messbare und konkrete Nachhaltigkeitsziele an, die Anleger nachvollziehen und mit Branchenstandards vergleichen können. Wir sind überzeugt, dass diese Strategie auch die Transparenz unserer Anlage- und Nachhaltigkeitskennzahlen gegenüber Benchmarks erhöht.

REDUZIERUNG UNSERER EMISSIONSBELASTUNG per 31. Dezember 2020

Durch unsere Nachhaltigkeitsstrategie konnten wir die Emissionsbelastung unserer Fonds, also die Summe der Emissionen aller Unternehmen in unseren Portfolios, deutlich reduzieren. Grundlage der Berechnungen ist die Treibhausgas-Emissionsintensität in Tonnen Kohlendioxidäquivalent (CO₂e) pro Million Euro Umsatz sowie das Emissionspotenzial aus den Reserven in Megatonnen CO₂.

Benchmark-Vergleich der Dimensional Nachhaltigkeitsfonds

Fonds	Reduzierung der Treibhausgas-Emissionsintensität ²	Reduzierung der Ausrichtung zu potentiellen Emissionen aus Reserven ²	Vergleichsindizes ³
Global Sustainability Core Equity	72,9%	100%	MSCI World
Global Sustainability Fixed Income (nur Unternehmensanleihen)	91,8%	100%	Bloomberg Global Aggregate Bond

Reduzierung der Emissionsbelastung verstehen²

Mit dem Dimensional Global Sustainability Core Equity Fonds können Anleger die Ausrichtung auf Emissionen in CO₂-Äquivalenten pro Million Euro gegenüber dem MSCI World um 65,7 Tonnen in einem Jahr senken.*



*Die Emissionsbelastung beruht auf dem repräsentativen Anteil an den Gesamtemissionen der Basiswerte des Portfolios und des Index bei einem Investitionsvolumen von einer Million Euro

†Gefahrene Kilometer mit einem durchschnittlichen Pkw. Berechnungen von Dimensional auf Grundlage von Daten der US-amerikanischen Environmental Protection Agency (EPA.gov). Weitere Informationen finden Sie unter Fußnote 2.

3. MSCI-Daten © MSCI 2021, alle Rechte vorbehalten. Bloomberg-Daten von Bloomberg. Anleger können nicht direkt in einen Index investieren. Die Wertentwicklung dieser Indizes zeigt nicht die mit der Verwaltung eines tatsächlichen Portfolios verbundenen Kosten an.
 4. Angaben in USD. Quelle: Berechnungen von Dimensional auf Grundlage von Daten von Bloomberg LP. In den Berechnungen ist das globale Aktienhandelsvolumen sowohl am Primär- als auch am Sekundärmarkt enthalten. ETFs und Fonds sind nicht berücksichtigt. Zur Berechnung des durchschnittlichen täglichen Handelsvolumens wird die Anzahl der an dem entsprechenden Tag gehandelten Aktien mit ihrem jeweiligen Schlusskurs multipliziert. Die täglichen Handelsvolumen werden anschließend addiert und durch 252 dividiert (entspricht in etwa der Zahl der Handelstage pro Jahr).

Anwendung der Dimensional Anlagephilosophie

Unsere Anlagephilosophie wird durch jahrzehntelange Forschung untermauert. Wie alle Dimensional Strategien, setzen auch unsere Nachhaltigkeitsfonds die wesentlichen Merkmale dieser Anlagephilosophie in die Praxis um:

Die Bedeutung der Marktpreise

Märkte sind effiziente Preisfindungsmaschinen. Täglich handeln weltweit mehrere Millionen Marktteilnehmer Wertpapiere und ihr kollektives Wissen fließt dabei in die Marktpreise ein. Wir versuchen nicht die Marktpreise vorherzusagen. Stattdessen nutzen wir die in den Marktpreisen enthaltenen Informationen und setzen Anlagestrategien um, die auf diesem Wissen beruhen.



Höhere erwartete Renditen anstreben

Die erwartete Rendite hängt von den aktuellen Marktpreisen und den erwarteten zukünftigen Cashflows ab. Dimensional strebt höhere erwartete Renditen an und orientiert sich dabei an aktuellen Marktpreisen und anderen Informationen.

AKTIEN

- GRÖSSE
Marktkapitalisierung
- RELATIVER PREIS⁶
Kurs/Buchwert-Verhältnis
- PROFITABILITÄT⁷
Betriebsergebnis/
Buchwert

ANLEIHEN

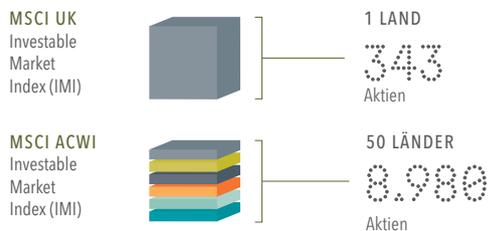
- LAUFZEIT
Zinssensitivität
- BONITÄT
Bonität des Emittenten
- WÄHRUNG
Emissionswährung

Breite Diversifikation

Diversifikation bezeichnet die Streuung des Anlagevermögens auf zahlreiche Wertpapiere und Märkte zur Steuerung des Fondsrisikos. Durch eine breite Diversifikation kann Dimensional einen Fonds so strukturieren, dass konsistentere Ergebnisse erzielt werden, indem das Anlageuniversum vergrößert und Risiken, die nicht mit höheren erwarteten Renditen verbunden sind, reduziert werden.

EIN LAND IM VERGLEICH ZUM GLOBALEN AKTIENMARKT (BEISPIEL)⁵

Stand: 31. Dezember 2020



Effiziente Ausführung

Kosten können die Rendite mindern. Einige Kosten, etwa die Kostenquote des Fonds, sind vergleichsweise transparent. Andere, zum Beispiel Handelskosten, sind hingegen relativ schwer nachvollziehbar. Wir wollen den renditemindernden Einfluss der Kosten weitestgehend reduzieren und achten daher auf sorgfältige Kostenkontrolle.

KOSTENMANAGEMENT



Anleger können nicht direkt in einen Index investieren. Die Wertentwicklung dieser Indizes zeigt nicht die mit der Verwaltung eines tatsächlichen Portfolios verbundenen Kosten an. Diversifikation beseitigt nicht das Risiko von Marktverlusten. **Es gibt keine Garantie, dass Investitionsstrategien erfolgreich sein werden.** Nur zu Illustrationszwecken. Weitere Informationen zu den Abbildungen und sonstige wichtige Informationen finden Sie auf der Rückseite.

5. Anzahl Positionen und Länder des MSCI United Kingdom Investable Market Index (IMI) und des MSCI ACWI (All Country World Index) Investable Market Index (IMI) per 31. Dezember 2020. MSCI-Daten © MSCI 2021, alle Rechte vorbehalten. **Internationale Anlagen beinhalten spezielle Risiken wie beispielsweise Währungsschwankungen und politische Instabilitäten. Anlagen in Wachstumsmärkten können diese Risiken verstärken.**

6. Der relative Preis wird anhand des Kurs-Buchwert-Verhältnisses gemessen; Value-Aktien sind Aktien mit einem niedrigeren Kurs-Buchwert-Verhältnis.

7. Profitabilität: bezieht sich auf die aktuelle Profitabilität und beruht auf Informationen aus den Gewinn- und Verlustrechnungen einzelner Unternehmen.

DIMENSIONAL AUF EINEN BLICK⁸

40

JAHRE SEIT DER
GRÜNDUNG UNSERES
UNTERNEHMENS

\$601 Mrd.

UNTERNEHMENSWEIT
VERWALTETES VERMÖGEN

1.400+

MITARBEITER IN
13 NIEDERLASSUNGEN
WELTWEIT

Eine

INVESTMENT-
PHILOSOPHIE

Dimensional⁹ ist ein globaler Vermögensverwalter und spezialisiert auf die Umsetzung der besten Ideen der Finanzwissenschaft. Seit vielen Jahren entwickeln wir auf Grundlage wissenschaftlicher Forschung praktische Anlagestrategien. Heute bietet Dimensional zahlreiche Aktien- und Anleihestrategien, die höhere erwartete Renditen anstreben.

Die Dimensional Anlagephilosophie beruht auf wirtschaftstheoretischen Erkenntnissen und den Ergebnissen jahrzehntelanger Forschung. Bei der Portfolioimplementierung entstehen Zielkonflikte, denen wir durch eine flexible Handelsstrategie entgegenwirken. Diese Strategie wenden wir in allen globalen und regionalen Aktien- und Anleihenstrategien an, mit dem Ziel, Mehrwert gegenüber herkömmlichen Fonds und Benchmarks zu generieren.

Wir sehen in unserem Anlagevermögen nicht nur Positionen in einem Portfolio, sondern die Ersparnisse und Träume, die unsere Kunden uns anvertrauen.

Diese Verantwortung nehmen wir sehr ernst. Neben dem Stammsitz des Unternehmens in Austin (Texas) unterhält Dimensional Niederlassungen in Nordamerika, Europa und Asien. So können wir weltweit investieren und unsere Strategien lückenlos umsetzen.

8. Jahre seit Gründung per 15. April 2021. Anlagevermögen in Milliarden US-Dollar; Stand: 31. Dezember 2020. Anzahl Mitarbeiter und Niederlassungen per 31. Dezember 2020. Mitarbeiter und Niederlassungen per 31. Dezember 2019.

9. „Dimensional“ bezieht sich auf die Gesellschaften aus der Dimensional-Unternehmensgruppe im Allgemeinen und nicht auf eine bestimmte Dimensional-Gesellschaft. Zu den Gesellschaften der Dimensional-Unternehmensgruppe gehören Dimensional Fund Advisors LP, Dimensional Fund Advisors Ltd., DFA Australia Limited, Dimensional Fund Advisors Canada ULC, Dimensional Fund Advisors Pte. Ltd., Dimensional Ireland Limited, 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.

NUR ZUM PROFESSIONELLEN GEBRAUCH. NICHT GEGENÜBER PRIVATANLEGERN GÜLTIG.

SO FERN VON DIMENSIONAL IRELAND LIMITED HERAUSGEGEBEN

Herausgegeben von Dimensional Ireland Limited (DIL), mit Sitz in 10 Earlsfort Terrace, Dublin 2, D02 T380, Irland. DIL 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).

SO FERN VON DIMENSIONAL FUND ADVISORS LTD. HERAUSGEGEBEN

Herausgegeben von Dimensional Fund Advisors Ltd. (DFAL), Geschäftsanschrift 20 Triton Street, Regent's Place, London, NW1 3BF. Firmennummer 02569601. DFAL 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.

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 DIL und DFAL, 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.

Das Herausgebende Unternehmen gibt Informationen und Unterlagen in Englisch heraus und kann die Informationen und Unterlagen zusätzlich auch in anderen Sprachen herausgeben. Die fortlaufende Akzeptanz von Informationen und Unterlagen durch den Empfänger von dem Herausgebenden Unternehmen konstituiert das Einverständnis des Empfängers, dass ihm die Informationen und Unterlagen, und sofern relevant in mehr als einer Sprache, zur Verfügung gestellt werden.

Quellen für Informationen zu Wertentwicklungen werden durch DFAL mit Stand des Datums dieses Dokuments bereitgestellt, sofern nicht anders angegeben. Aktuelle Daten zur Wertentwicklung zum letzten Monatsende finden Sie auf unserer Webseite dimensional.com. Die durchschnittliche Gesamtjahresrendite umfasst Renditen aus Reinvestition von Dividenden und von sonstigen Erträgen.

„Dimensional“ bezieht sich auf die Gesellschaften aus der Dimensional-Unternehmensgruppe im Allgemeinen und nicht auf eine bestimmte Dimensional-Gesellschaft. Zu den Gesellschaften der Dimensional-Unternehmensgruppe gehören Dimensional Fund Advisors LP, Dimensional Fund Advisors Ltd., DFA Australia Limited, Dimensional Fund Advisors Canada ULC, Dimensional Fund Advisors Pte. Ltd., Dimensional Ireland Limited, 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.

Der Emerging Markets Sustainability Core Equity Fund, Global Sustainability Core Equity Fund, Global Sustainability Fixed Income Fund und Global Sustainability Short Fixed Income Fund (Die Implementation und Verwaltung

des/der Emerging Markets Sustainability Core Equity Fund, Global Sustainability Core Equity Fund, Global Sustainability Fixed Income Fund und Global Sustainability Short Fixed Income Fund ist durch die US-amerikanische Patentnummern 7,596,525 B1, 7,599,874 B1 und 8,438,092 B2 geschützt.) sind Teilfonds von Dimensional Funds Plc (die „Dimensional Funds“), 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 Wertpapiere (OGAW) von der Central Bank of Ireland zugelassen.

Dimensional Funds Plc („Dimensional Funds“) werden ausschließlich gemäß den Bedingungen des jeweiligen Fondsprospektes und der entsprechenden wesentlichen Anlegerinformation (Key Investor Information Document, KIID) angeboten. Vor einem Investment empfehlen wir Ihnen, sich ausführlich mit den Zielen, Risiken, Gebühren und Kosten der Dimensional Funds zu befassen. Für diese und weitere Informationen über Dimensional Funds lesen Sie bitte den Prospekt und die wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) sorgfältig durch, bevor Sie ein Investment tätigen. Sie erhalten die aktuellste Version des jeweiligen Prospekts (in Englisch erhältlich) und die entsprechenden KIID (in Englisch und der jeweiligen Landessprache erhältlich) unter dimensional.com oder indem Sie unseren Fondsadministrator bzw. Investmentmanager unter +44 (0)20 30333 3300 kontaktieren.

Darüber steht eine Zusammenfassung der Anlegerrechte unter <https://eu.dimensional.com/-/media/Dimensional/Documents/EMEA/summary-of-shareholder-rights.pdf>. (Zusammenfassung der Anlegerrechte) zur Verfügung. Die Zusammenfassung ist in englischer Sprache verfügbar.

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

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 Erwerbskurs liegen kann. Die Wertentwicklung in der Vergangenheit stellt keine Garantie für zukünftige Entwicklungen dar. Es gibt keine Garantie dafür, dass Strategien erfolgreich sind.

Wertentwicklungsdaten zeigen die Wertentwicklung in der Vergangenheit. Die Wertentwicklung in der Vergangenheit stellt keine Garantie für zukünftige Entwicklungen dar und die aktuelle Wertentwicklung kann über oder unter der gezeigten 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 aufmerksam lesen.

Überprüfungen von Umwelt- und Sozialaspekten können Anlagemöglichkeiten für den Fonds einschränken.

dimensional.com